

景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金
2024 年中期报告

2024 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：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 3.3 其他指标 | 9 |
| § 4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 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 | 13 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 13 |
| § 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 | 15 |
| 6.3 净资产变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 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 | 40 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 55 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 56 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 56 |
| 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 | 56 |
| 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 | 56 |
| 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 | 56 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 56 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 57 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 57 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 58 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 58 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 58 |
| 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 | 58 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 59 |
| § 10 重大事件揭示 | 59 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 59 |
| 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 | 59 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 59 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 59 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 59 |
| 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 | 59 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 60 |
| 10.8 其他重大事件 | 61 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 62 |
| 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 | 62 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 62 |
| § 12 备查文件目录 | 63 |
| 12.1 备查文件目录 | 63 |
| 12.2 存放地点 | 63 |
| 12.3 查阅方式 | 63 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------------|--------------------|
| 基金名称 | 景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 景顺长城中证 1000 指数增强 | |
| 基金主代码 | 015495 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2022 年 4 月 27 日 | |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中信建投证券股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 132,608,868.66 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 景顺长城中证 1000 指数增强 A | 景顺长城中证 1000 指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 015495 | 015496 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 60,673,640.83 份 | 71,935,227.83 份 |

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，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>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，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>本基金可投资国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。</p> <p>6、股票期权投资策略</p> <p>本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p>7、资产支持证券投资策略 本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。</p> <p>8、参与融资及转融通证券出借业务的投资策略 本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。</p> <p>9、信用衍生品投资策略 本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 1000 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5% |
| 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 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 杨皞阳 | 朱志明 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 | 4008-888-108 |
| | 电子邮箱 | investor@igwfm.com | service@csc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008888606 | 95587 |
| 传真 | | 0755-22381339 | 010-85130975 |
| 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 | 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 |
| 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 | 北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层/18 层，北京市朝阳区光华路 10 号院中信大厦 82 层 |
| 邮政编码 | | 518048 | 100010 |
| 法定代表人 | | 李进 | 王常青 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 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 | 景顺长城基金管理有限公司 | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2024年1月1日-2024年6月30日) | |
|---------------|---------------------------|--------------------|
| | 景顺长城中证 1000 指数增强 A | 景顺长城中证 1000 指数增强 C |
| 本期已实现收益 | -4,339,345.17 | -7,331,964.71 |
| 本期利润 | -6,937,590.14 | -10,377,409.38 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1150 | -0.0976 |
| 本期加权平均净值利润率 | -12.64% | -10.81% |
| 本期基金份额净值增长率 | -11.61% | -11.78% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | -7,986,318.61 | -10,010,360.41 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1316 | -0.1392 |
| 期末基金资产净值 | 52,687,322.22 | 61,924,867.42 |
| 期末基金份额净值 | 0.8683 | 0.8608 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | -13.17% | -13.92% |

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城中证 1000 指数增强 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | -6.91% | 1.29% | -8.15% | 1.36% | 1.24% | -0.07% |
| 过去三个月 | -6.03% | 1.34% | -9.51% | 1.42% | 3.48% | -0.08% |
| 过去六个月 | -11.61% | 1.86% | -15.97% | 1.87% | 4.36% | -0.01% |
| 过去一年 | -18.07% | 1.46% | -24.61% | 1.47% | 6.54% | -0.01% |
| 自基金合同生效起 | -13.17% | 1.25% | -6.44% | 1.31% | -6.73% | -0.06% |

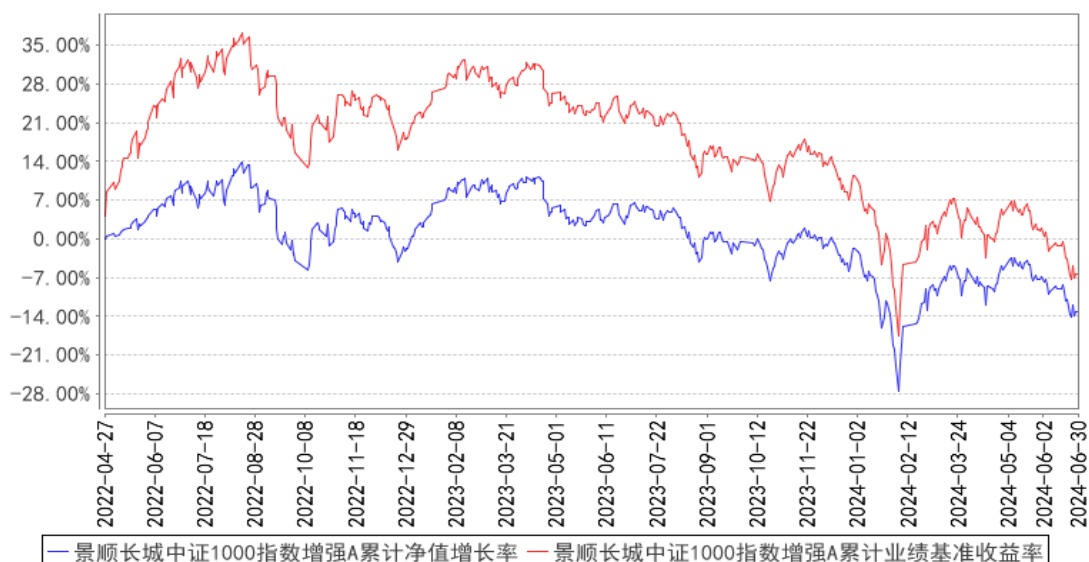
| | | | | | | |
|----|--|--|--|--|--|--|
| 至今 | | | | | | |
|----|--|--|--|--|--|--|

景顺长城中证 1000 指数增强 C

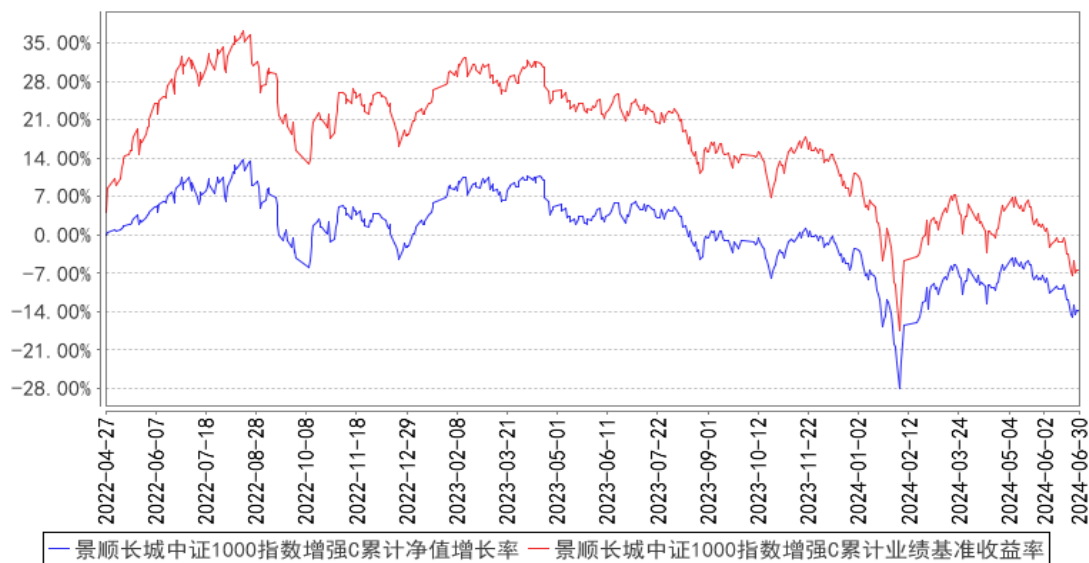
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | -6.94% | 1.29% | -8.15% | 1.36% | 1.21% | -0.07% |
| 过去三个月 | -6.12% | 1.34% | -9.51% | 1.42% | 3.39% | -0.08% |
| 过去六个月 | -11.78% | 1.86% | -15.97% | 1.87% | 4.19% | -0.01% |
| 过去一年 | -18.39% | 1.46% | -24.61% | 1.47% | 6.22% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -13.92% | 1.25% | -6.44% | 1.31% | -7.48% | -0.06% |

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1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证，下同）的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自 2022 年 4 月 27 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 2024 年 6 月 30 日，本公司旗

下共管理 184 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 | | |
| 徐喻军 | 本基金的基金经理 | 2022 年 4 月 27 日 | - | 14 年 | 理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员，自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 14 年证券、基金行业从业经验。 |
| 黎海威 | 本基金的基金经理 | 2022 年 4 月 27 日 | - | 21 年 | 经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有 21 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 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 9 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

2024 年上半年，国内经济在经历了一季度的亮眼开局之后出现一定的边际走弱，较强的出口数据带动工业生产保持韧性，内需在地产持续下行、居民预期偏弱的背景下仍旧疲弱。从数据来看，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 50.4、49.5、49.5，5、6 两月 PMI 重新跌入收缩区间。今年前 6 个月工业增加值累计同比增长 6.0%，其中 6 月份工业增加值当月同比增长 5.3%，经济延续弱复苏的格局。6 月 CPI 同比上升 0.2%，环比下降 0.2%；PPI 同比下降 0.8%，环比下降 0.2%，价格类指标依旧偏弱。6 月 M2 同比增长 6.2%，M1 同比下降 5.0%，信贷需求仍然偏弱；6 月末外汇储备 3.22 万亿美元，汇率短期承压。整体而言，国内经济依然处于弱复苏的态势，“稳增长”政策的效果正在逐步显现。上半年 A 股市场震荡调整，结构有所分化，上证指数下跌 0.25%，沪深 300 指数上涨 0.89%，创业板指数下跌 10.99%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年上半年，景顺长城中证 1000 指数增强 A 份额净值增长率为-11.61%，业绩比较基准收益率为-15.97%。

2024 年上半年，景顺长城中证 1000 指数增强 C 份额净值增长率为-11.78%，业绩比较基准收益率为-15.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，海外方面，美联储的货币政策依然是市场关注的热点，但其对国内资本市场的边际影响明显降低。国内方面，我们认为三季度国内经济环比二季度大概率能够边际回升，前期政策的累积效应以及新的“稳增长”政策对经济形成一定支撑；新“国九条”的推出将会改

善股市微观供需结构，并进一步提升 A 股市场的投资价值。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

本基金是以中证 1000 指数为基准的指数增强基金，我们的投资组合主要以基本面量化选股为主，风格上维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生成长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生持续稳定的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关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

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§ 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 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 6,488,946.03 | 12,291,515.77 |
| 结算备付金 | | 194,187.67 | 449,156.23 |
| 存出保证金 | | - | 561,273.60 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 108,249,805.55 | 136,776,147.08 |
| 其中：股票投资 | | 108,249,805.55 | 136,657,139.11 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | 119,007.97 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 48,037.15 | 333,904.78 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 114,980,976.40 | 150,411,997.46 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 105,657.96 | 92,728.26 |
| 应付管理人报酬 | | 125,948.30 | 118,811.48 |
| 应付托管费 | | 18,892.24 | 17,821.71 |
| 应付销售服务费 | | 32,268.97 | 28,309.03 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | 0.21 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 86,019.29 | 160,049.83 |
| 负债合计 | | 368,786.76 | 417,720.52 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 132,608,868.66 | 153,325,235.17 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | -17,996,679.02 | -3,330,958.23 |
| 净资产合计 | | 114,612,189.64 | 149,994,276.94 |
| 负债和净资产总计 | | 114,980,976.40 | 150,411,997.46 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 132,608,868.66 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 0.8683 元，基金份额 60,673,640.83 份；本基金 C 类份额净值人民币 0.8608 元，基金份额 71,935,227.83 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| 一、营业总收入 | | -16,177,371.51 | 13,327,040.75 |
| 1. 利息收入 | | 44,277.17 | 48,158.38 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 44,277.17 | 48,158.38 |
| 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） | | -10,656,905.89 | 5,358,579.05 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -12,102,499.71 | 4,156,798.05 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 20,199.79 | 122,448.71 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.16 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | -251,720.17 | -83,296.02 |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 1,677,114.20 | 1,162,628.31 |
| 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 | -5,643,689.64 | 7,871,002.72 |
| 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 | 78,946.85 | 49,300.60 |
| 减：二、营业总支出 | | 1,137,628.01 | 1,081,552.58 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 751,550.76 | 724,413.30 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 112,732.68 | 108,662.01 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 191,603.79 | 163,810.13 |
| 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 | | 2, 177. 66 | 364. 58 |
| 8. 其他费用 | 6. 4. 7. 23 | 79, 563. 12 | 84, 302. 56 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -17, 314, 999. 52 | 12, 245, 488. 17 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -17, 314, 999. 52 | 12, 245, 488. 17 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -17, 314, 999. 52 | 12, 245, 488. 17 |

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|-------------------------------------|---------------------------------------|--------|-------------------|-------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 153, 325, 235. 17 | - | -3, 330, 958. 23 | 149, 994, 276. 94 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 153, 325, 235. 17 | - | -3, 330, 958. 23 | 149, 994, 276. 94 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -20, 716, 366. 51 | - | -14, 665, 720. 79 | -35, 382, 087. 30 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -17, 314, 999. 52 | -17, 314, 999. 52 |
| （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） | -20, 716, 366. 51 | - | 2, 649, 278. 73 | -18, 067, 087. 78 |
| 其中：1. 基金申购款 | 83, 280, 428. 76 | - | -9, 497, 992. 70 | 73, 782, 436. 06 |
| 2. 基金赎回 | -103, 996, 795. 2 | - | 12, 147, 271. 43 | -91, 849, 523. 84 |

| | | | | |
|--|---------------------------------|--------|----------------|----------------|
| 回款 | 7 | | | |
| (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 | 132,608,868.66 | - | -17,996,679.02 | 114,612,189.64 |
| 项目 | 上年度可比期间 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 | 155,883,570.10 | - | -2,812,378.52 | 153,071,191.58 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 155,883,570.10 | - | -2,812,378.52 | 153,071,191.58 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -27,979,067.14 | - | 10,110,007.12 | -17,869,060.02 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 12,245,488.17 | 12,245,488.17 |
| (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) | -27,979,067.14 | - | -2,135,481.05 | -30,114,548.19 |
| 其中：1. 基金申购款 | 27,717,443.05 | - | 2,140,789.97 | 29,858,233.02 |
| 2. 基金赎回款 | -55,696,510.19 | - | -4,276,271.02 | -59,972,781.21 |
| (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) | - | - | - | - |

| | | | | |
|------------------|----------------|---|--------------|----------------|
| 填列) | | | | |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 127,904,502.96 | - | 7,297,628.60 | 135,202,131.56 |

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 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2022]478 号文《关于准予景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准，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 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2022 年 4 月 27 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 581,796,523.71 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 107,725.39 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 581,904,249.10 元，折合 581,904,249.10 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

根据《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用，且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产净值中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

本基金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、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政

府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。

基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%,投资于标的指数成份股及其备选成份股(含存托凭证,下同)的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率 \times 95%+商业银行活期存款利率(税后) \times 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 2024 年 8 月 28 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、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 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) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基

金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，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费附加。

(3) 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

(4) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

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 | |
|-------------------|-----------------|--------------|
| | 2024 年 6 月 30 日 | |
| 活期存款 | | 4,547,608.56 |
| 等于：本金 | | 4,545,618.90 |
| 加：应计利息 | | 1,989.66 |
| 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 | | 1,941,337.47 |
| 等于：本金 | | 1,940,792.93 |
| 加：应计利息 | | 544.54 |
| 减：坏账准备 | | - |
| 合计 | | 6,488,946.03 |

注：其他存款为存放在证券经纪商经纪专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | | | |
|---------------|-----------------|------|----------------|---------------|
| | 2024 年 6 月 30 日 | | | |
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 115,780,351.75 | - | 108,249,805.55 | -7,530,546.20 |
| 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 | 115,780,351.75 | - | 108,249,805.55 | -7,530,546.20 |

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

本基金本报告期末的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 |
|----|-----|
|----|-----|

| | 2024 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 79.17 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 79,563.12 |
| 其他 | 6,377.00 |
| 合计 | 86,019.29 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城中证 1000 指数增强 A

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 58,382,476.41 | 58,382,476.41 |
| 本期申购 | 14,257,925.24 | 14,257,925.24 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -11,966,760.82 | -11,966,760.82 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 60,673,640.83 | 60,673,640.83 |

景顺长城中证 1000 指数增强 C

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 94,942,758.76 | 94,942,758.76 |
| 本期申购 | 69,022,503.52 | 69,022,503.52 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -92,030,034.45 | -92,030,034.45 |
| 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 | 71,935,227.83 | 71,935,227.83 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城中证 1000 指数增强 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 2,587,425.64 | -3,617,065.75 | -1,029,640.11 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 2,587,425.64 | -3,617,065.75 | -1,029,640.11 |
| 本期利润 | -4,339,345.17 | -2,598,244.97 | -6,937,590.14 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 239.21 | -19,327.57 | -19,088.36 |
| 其中：基金申购款 | -168,822.83 | -894,847.49 | -1,063,670.32 |
| 基金赎回款 | 169,062.04 | 875,519.92 | 1,044,581.96 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -1,751,680.32 | -6,234,638.29 | -7,986,318.61 |

景顺长城中证 1000 指数增强 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 上年度末 | 3,580,161.72 | -5,881,479.84 | -2,301,318.12 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 3,580,161.72 | -5,881,479.84 | -2,301,318.12 |
| 本期利润 | -7,331,964.71 | -3,045,444.67 | -10,377,409.38 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,108,679.77 | 1,559,687.32 | 2,668,367.09 |
| 其中：基金申购款 | -1,917,192.31 | -6,517,130.07 | -8,434,322.38 |
| 基金赎回款 | 3,025,872.08 | 8,076,817.39 | 11,102,689.47 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -2,643,123.22 | -7,367,237.19 | -10,010,360.41 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 27,369.43 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 5,856.52 |
| 结算备付金利息收入 | 11,051.22 |
| 其他 | - |
| 合计 | 44,277.17 |

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 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -12,102,499.71 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | -12,102,499.71 |

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 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 636,609,959.30 |
| 减：卖出股票成本总额 | 647,660,918.33 |
| 减：交易费用 | 1,051,540.68 |
| 买卖股票差价收入 | -12,102,499.71 |

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 16.16 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 20,183.63 |
| 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 | 20,199.79 |

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 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 139,213.67 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 119,000.00 |
| 减：应计利息总额 | 24.51 |
| 减：交易费用 | 5.53 |

| | |
|----------|-----------|
| 买卖债券差价收入 | 20,183.63 |
|----------|-----------|

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 股指期货投资收益 | -251,720.17 |

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,677,114.20 |
| 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 | 1,677,114.20 |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -5,749,969.64 |
| 股票投资 | -5,749,969.64 |
| 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 | 106,280.00 |
| 权证投资 | - |
| 期货投资 | 106,280.00 |
| 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 | -5,643,689.64 |

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 70,998.47 |
| 基金转换费收入 | 7,948.38 |
| 合计 | 78,946.85 |

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 |
|---------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 审计费用 | 19,890.78 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 合计 | 79,563.12 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---------------------|-------------------|
| 景顺长城基金管理有限公司 | 基金管理人、登记机构、基金销售机构 |
| 中信建投证券股份有限公司（“中信建投” | 基金托管人、基金销售机构 |

| | |
|---------------------|-----------------|
| 证券”) | |
| 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 |

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 2024年1月1日至2024年6月30日 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 (%) |
| 中信建投证券 | 1,205,555,975.47 | 95.60 | 1,250,261,727.41 | 100.00 |

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 2024年1月1日至2024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 (%) |
| 中信建投证券 | 622,815.11 | 95.49 | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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 (%) |
| 中信建投证券 | 646,273.11 | 100.00 | - | - |

注：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。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 2024年1月1日至2024年6 月30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 751,550.76 | 724,413.30 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护 | 192,383.47 | 186,212.96 |

| | | |
|---------------|------------|------------|
| 费 | | |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 559,167.29 | 538,200.34 |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 112,732.68 | 108,662.01 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|----------------------|-----------------|------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 景顺长城中证1000指数增强A | 景顺长城中证1000指数增强C | 合计 |
| 景顺长城基金管理有限公司 | - | 106,794.95 | 106,794.95 |
| 中信建投证券 | - | 56,144.42 | 56,144.42 |
| 长城证券 | - | 11.20 | 11.20 |
| 合计 | - | 162,950.57 | 162,950.57 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 景顺长城中证1000指数增强A | 景顺长城中证1000指数增强C | 合计 |
| 景顺长城基金管理有限公司 | - | 98,447.36 | 98,447.36 |
| 中信建投证券 | - | 40,229.36 | 40,229.36 |
| 长城证券 | - | - | - |
| 合计 | - | 138,676.72 | 138,676.72 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间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 2024年1月1日至2024年6月30日 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 |
| 中信建投证券- 证券资金账户 | 1,365,277.58 | 3,760.24 | 4,299,273.52 | 4,875.43 |

注：基金托管人中信建投证券受托作为本基金的证券经纪商。上述款项为本基金存放于中信建投证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

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(2024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 |
|--------|------|-------------|---------|--------|-------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 001379 | 腾达科技 | 2024年1月11日 | 6个月 | 新股流通受限 | 16.98 | 13.48 | 107 | 1,816.86 | 1,442.36 | - |
| 001389 | 广合科技 | 2024年3月26日 | 6个月 | 新股流通受限 | 17.43 | 34.56 | 132 | 2,300.76 | 4,561.92 | - |
| 301392 | 汇成真空 | 2024年5月28日 | 6个月 | 新股流通受限 | 12.20 | 41.66 | 219 | 2,671.80 | 9,123.54 | - |
| 301536 | 星辰科技 | 2024年3月20日 | 6个月 | 新股流通受限 | 16.16 | 32.27 | 273 | 4,411.68 | 8,809.71 | - |
| 301539 | 宏鑫科技 | 2024年4月3日 | 6个月 | 新股流通受限 | 10.64 | 19.82 | 361 | 3,841.04 | 7,155.02 | - |
| 301565 | 中仑新材 | 2024年6月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.88 | 18.98 | 386 | 4,585.68 | 7,326.28 | - |
| 301566 | 达利凯普 | 2023年12月22日 | 6个月以上 | 新股流通受限 | 8.90 | 16.97 | 395 | 3,515.50 | 6,703.15 | - |
| 301587 | 中瑞股份 | 2024年3月27日 | 6个月 | 新股流通受限 | 21.73 | 25.26 | 196 | 4,259.08 | 4,950.96 | - |
| 301588 | 美新科技 | 2024年3月6日 | 6个月 | 新股流通受限 | 14.50 | 21.25 | 254 | 3,683.00 | 5,397.50 | - |
| 603082 | 北自科技 | 2024年1月23日 | 6个月 | 新股流通受限 | 21.28 | 29.49 | 71 | 1,510.88 | 2,093.79 | - |
| 603285 | 键邦股份 | 2024年6月28日 | 1个月内(含) | 新股流通受限 | 18.65 | 18.65 | 762 | 14,211.30 | 14,211.30 | - |
| 603285 | 键邦股份 | 2024年6月28日 | 6个月 | 新股流通受限 | 18.65 | 18.65 | 85 | 1,585.25 | 1,585.25 | - |
| 603312 | 西典新能 | 2024年1月4日 | 6个月 | 新股流通受限 | 29.02 | 25.36 | 54 | 1,567.08 | 1,369.44 | - |
| 603325 | 博隆技术 | 2024年1月3日 | 6个月 | 新股流通受限 | 72.46 | 68.06 | 23 | 1,666.58 | 1,565.38 | - |
| 603341 | 龙旗科技 | 2024年2月23日 | 6个月 | 新股流通受限 | 26.00 | 37.49 | 76 | 1,976.00 | 2,849.24 | - |
| 603344 | 星德胜 | 2024年3月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.18 | 22.66 | 89 | 1,707.02 | 2,016.74 | - |
| 603350 | 安乃达 | 2024年6月26日 | 1个月内(含) | 新股流通受限 | 20.56 | 20.56 | 772 | 15,872.32 | 15,872.32 | - |
| 603350 | 安乃达 | 2024年6月26日 | 6个月 | 新股流通受限 | 20.56 | 20.56 | 86 | 1,768.16 | 1,768.16 | - |
| 603375 | 盛景微 | 2024年1月17日 | 6个月 | 新股流通受限 | 38.18 | 38.90 | 43 | 1,641.74 | 1,672.70 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|------|--------|-------|--------|-----|----------|-----------|---|
| 603381 | 永臻股份 | 2024 年 6 月 19 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 23.35 | 25.13 | 74 | 1,727.90 | 1,859.62 | - |
| 688530 | 欧莱新材 | 2024 年 4 月 29 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 9.60 | 16.10 | 344 | 3,302.40 | 5,538.40 | - |
| 688691 | 灿芯股份 | 2024 年 4 月 2 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 19.86 | 42.51 | 181 | 3,594.66 | 7,694.31 | - |
| 688692 | 达梦数据 | 2024 年 6 月 4 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 86.96 | 174.93 | 60 | 5,217.60 | 10,495.80 | - |
| 688695 | 中创股份 | 2024 年 3 月 6 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 22.43 | 31.55 | 146 | 3,274.78 | 4,606.30 | - |
| 688709 | 成都华微 | 2024 年 1 月 31 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 15.69 | 18.79 | 269 | 4,220.61 | 5,054.51 | - |

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 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券（上年度末：0.08%）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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 2024 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 | 6,488,946.03 | - | - | - | - | - | 6,488,946.03 |
| 结算备付金 | 194,187.67 | - | - | - | - | - | 194,187.67 |
| 交易性金融 资产 | - | - | - | - | - | -108,249,805.55 | 108,249,805.55 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 48,037.15 | 48,037.15 |
| 资产总计 | 6,683,133.70 | - | - | - | - | -108,297,842.70 | 114,980,976.40 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 105,657.96 | 105,657.96 |
| 应付管理人 报酬 | - | - | - | - | - | 125,948.30 | 125,948.30 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 18,892.24 | 18,892.24 |
| 应付销售服 务费 | - | - | - | - | - | 32,268.97 | 32,268.97 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 86,019.29 | 86,019.29 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 368,786.76 | 368,786.76 |
| 利率敏感度 缺口 | 6,683,133.70 | - | - | - | - | - | - |
| 上年度末 2023 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 | 12,291,515.77 | - | - | - | - | - | 12,291,515.77 |
| 结算备付金 | 449,156.23 | - | - | - | - | - | 449,156.23 |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - | 561,273.60 | 561,273.60 |
| 交易性金融 资产 | - | - | - | -96,006.31 | 23,001.66 | 136,657,139.11 | 136,776,147.08 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 333,904.78 | 333,904.78 |
| 资产总计 | 12,740,672.00 | - | - | -96,006.31 | 23,001.66 | 137,552,317.49 | 150,411,997.46 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 92,728.26 | 92,728.26 |
| 应付管理人 报酬 | - | - | - | - | - | 118,811.48 | 118,811.48 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 17,821.71 | 17,821.71 |
| 应付销售服 务费 | - | - | - | - | - | 28,309.03 | 28,309.03 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 0.21 | 0.21 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 160,049.83 | 160,049.83 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 417,720.52 | 417,720.52 |

| | | | | | | |
|---------|---------------|---|------------|-----------|---|---|
| 利率敏感度缺口 | 12,740,672.00 | - | -96,006.31 | 23,001.66 | - | - |
|---------|---------------|---|------------|-----------|---|---|

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：0.08%），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 2024年6月30日 | | 上年度末 2023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 | 108,249,805.55 | 94.45 | 136,657,139.11 | 91.11 |
| 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 | 108,249,805.55 | 94.45 | 136,657,139.11 | 91.11 |

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（2024年6月30日） | 上年度末（2023年12月） |

| | | | |
|--|----------------|---------------|---------------|
| | | | 31 日) |
| | 沪深 300 指数上升 5% | 9,011,453.83 | 6,906,327.25 |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -9,011,453.83 | -6,906,327.25 |

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 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 108,114,081.85 | 136,401,903.73 |
| 第二层次 | 40,140.18 | 119,007.97 |
| 第三层次 | 95,583.52 | 255,235.38 |
| 合计 | 108,249,805.55 | 136,776,147.08 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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 | 108,249,805.55 | 94.15 |
| | 其中：股票 | 108,249,805.55 | 94.15 |
| 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 | 6,683,133.70 | 5.81 |
| 8 | 其他各项资产 | 48,037.15 | 0.04 |
| 9 | 合计 | 114,980,976.40 | 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 | 9,696.00 | 0.01 |
| B | 采矿业 | 3,081,246.80 | 2.69 |
| C | 制造业 | 70,169,059.07 | 61.22 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,046,710.00 | 3.53 |
| E | 建筑业 | 1,901,080.00 | 1.66 |
| F | 批发和零售业 | 5,315,986.00 | 4.64 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,751,218.60 | 1.53 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 10,505,433.69 | 9.17 |
| J | 金融业 | 1,616,438.25 | 1.41 |
| K | 房地产业 | 2,165,151.00 | 1.89 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,593,163.00 | 1.39 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,461,982.65 | 1.28 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 591,289.00 | 0.52 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 940,581.00 | 0.82 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,929,782.00 | 1.68 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 107,078,817.06 | 93.43 |

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 | 43,983.00 | 0.04 |
| C | 制造业 | 759,276.08 | 0.66 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 50,331.00 | 0.04 |
| E | 建筑业 | 46,992.00 | 0.04 |
| 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 | 209,225.41 | 0.18 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 17,743.00 | 0.02 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 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 | 43,438.00 | 0.04 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,170,988.49 | 1.02 |

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 | 600718 | 东软集团 | 121,200 | 1,002,324.00 | 0.87 |
| 2 | 300679 | 电连技术 | 24,000 | 965,520.00 | 0.84 |
| 3 | 688018 | 乐鑫科技 | 9,755 | 962,623.40 | 0.84 |
| 4 | 002318 | 久立特材 | 41,200 | 961,196.00 | 0.84 |
| 5 | 002237 | 恒邦股份 | 78,600 | 904,686.00 | 0.79 |
| 6 | 002100 | 天康生物 | 129,600 | 898,128.00 | 0.78 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 7 | 002351 | 漫步者 | 65,000 | 854,750.00 | 0.75 |
| 8 | 300379 | 东方通 | 105,000 | 848,400.00 | 0.74 |
| 9 | 603368 | 柳药集团 | 46,200 | 808,500.00 | 0.71 |
| 10 | 002550 | 千红制药 | 148,700 | 801,493.00 | 0.70 |
| 11 | 002773 | 康弘药业 | 36,700 | 794,555.00 | 0.69 |
| 12 | 002706 | 良信股份 | 115,300 | 790,958.00 | 0.69 |
| 13 | 603583 | 捷昌驱动 | 37,400 | 762,212.00 | 0.67 |
| 14 | 605111 | 新洁能 | 24,680 | 754,961.20 | 0.66 |
| 15 | 000034 | 神州数码 | 32,800 | 750,792.00 | 0.66 |
| 16 | 300244 | 迪安诊断 | 61,600 | 739,200.00 | 0.64 |
| 17 | 600285 | 羚锐制药 | 29,900 | 723,879.00 | 0.63 |
| 18 | 605589 | 圣泉集团 | 35,400 | 718,266.00 | 0.63 |
| 19 | 000690 | 宝新能源 | 140,400 | 716,040.00 | 0.62 |
| 20 | 000758 | 中色股份 | 140,560 | 714,044.80 | 0.62 |
| 21 | 301050 | 雷电微力 | 14,800 | 712,768.00 | 0.62 |
| 22 | 002139 | 拓邦股份 | 66,900 | 710,478.00 | 0.62 |
| 23 | 601126 | 四方股份 | 36,800 | 707,296.00 | 0.62 |
| 24 | 600312 | 平高电气 | 34,100 | 663,245.00 | 0.58 |
| 25 | 300482 | 万孚生物 | 26,800 | 653,920.00 | 0.57 |
| 26 | 002158 | 汉钟精机 | 39,100 | 653,752.00 | 0.57 |
| 27 | 000600 | 建投能源 | 102,300 | 644,490.00 | 0.56 |
| 28 | 002020 | 京新药业 | 61,000 | 638,670.00 | 0.56 |
| 29 | 300638 | 广和通 | 37,100 | 634,410.00 | 0.55 |
| 30 | 000550 | 江铃汽车 | 29,200 | 633,932.00 | 0.55 |
| 31 | 603025 | 大豪科技 | 45,500 | 628,810.00 | 0.55 |
| 32 | 002215 | 诺普信 | 83,500 | 622,075.00 | 0.54 |
| 33 | 002583 | 海能达 | 152,000 | 618,640.00 | 0.54 |
| 34 | 002249 | 大洋电机 | 129,500 | 612,535.00 | 0.53 |
| 35 | 300451 | 创业慧康 | 176,400 | 610,344.00 | 0.53 |
| 36 | 002061 | 浙江交科 | 166,800 | 608,820.00 | 0.53 |
| 37 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 78,300 | 606,825.00 | 0.53 |
| 38 | 600320 | 振华重工 | 176,000 | 601,920.00 | 0.53 |
| 39 | 300323 | 华灿光电 | 134,900 | 586,815.00 | 0.51 |
| 40 | 300034 | 钢研高纳 | 36,900 | 586,341.00 | 0.51 |
| 41 | 688123 | 聚辰股份 | 9,532 | 579,831.56 | 0.51 |
| 42 | 603328 | 依顿电子 | 73,700 | 579,282.00 | 0.51 |
| 43 | 600933 | 爱柯迪 | 38,900 | 575,331.00 | 0.50 |
| 44 | 600916 | 中国黄金 | 59,300 | 570,466.00 | 0.50 |
| 45 | 002267 | 陕天然气 | 74,700 | 564,732.00 | 0.49 |
| 46 | 300130 | 新国都 | 33,800 | 562,432.00 | 0.49 |
| 47 | 002928 | 华夏航空 | 87,500 | 554,750.00 | 0.48 |
| 48 | 002276 | 万马股份 | 77,200 | 553,524.00 | 0.48 |
| 49 | 688016 | 心脉医疗 | 5,628 | 551,825.40 | 0.48 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|---------|------------|------|
| 50 | 688578 | 艾力斯 | 8,616 | 549,183.84 | 0.48 |
| 51 | 688158 | 优刻得 | 53,037 | 542,568.51 | 0.47 |
| 52 | 300783 | 三只松鼠 | 24,300 | 531,441.00 | 0.46 |
| 53 | 002204 | 大连重工 | 123,400 | 526,918.00 | 0.46 |
| 54 | 601886 | 江河集团 | 107,100 | 522,648.00 | 0.46 |
| 55 | 000415 | 渤海租赁 | 203,100 | 517,905.00 | 0.45 |
| 56 | 600649 | 城投控股 | 155,500 | 516,260.00 | 0.45 |
| 57 | 000951 | 中国重汽 | 35,500 | 508,360.00 | 0.44 |
| 58 | 600587 | 新华医疗 | 31,650 | 498,171.00 | 0.43 |
| 59 | 300973 | 立高食品 | 17,500 | 491,575.00 | 0.43 |
| 60 | 000821 | 京山轻机 | 43,300 | 490,589.00 | 0.43 |
| 61 | 301219 | 腾远钴业 | 12,820 | 490,493.20 | 0.43 |
| 62 | 002068 | 黑猫股份 | 68,800 | 488,480.00 | 0.43 |
| 63 | 688372 | 伟测科技 | 12,092 | 475,578.36 | 0.41 |
| 64 | 601137 | 博威合金 | 31,200 | 475,488.00 | 0.41 |
| 65 | 300841 | 康华生物 | 9,300 | 470,952.00 | 0.41 |
| 66 | 600480 | 凌云股份 | 47,600 | 467,908.00 | 0.41 |
| 67 | 300226 | 上海钢联 | 27,600 | 467,544.00 | 0.41 |
| 68 | 300573 | 兴齐眼药 | 2,840 | 465,760.00 | 0.41 |
| 69 | 600037 | 歌华有线 | 75,500 | 451,490.00 | 0.39 |
| 70 | 600366 | 宁波韵升 | 86,200 | 449,964.00 | 0.39 |
| 71 | 300458 | 全志科技 | 19,130 | 449,746.30 | 0.39 |
| 72 | 002088 | 鲁阳节能 | 37,100 | 448,539.00 | 0.39 |
| 73 | 603348 | 文灿股份 | 15,800 | 437,502.00 | 0.38 |
| 74 | 600685 | 中船防务 | 15,500 | 432,450.00 | 0.38 |
| 75 | 600158 | 中体产业 | 54,600 | 419,874.00 | 0.37 |
| 76 | 603393 | 新天然气 | 12,000 | 416,880.00 | 0.36 |
| 77 | 002705 | 新宝股份 | 29,300 | 412,251.00 | 0.36 |
| 78 | 601975 | 招商南油 | 112,200 | 402,798.00 | 0.35 |
| 79 | 002332 | 仙琚制药 | 34,700 | 395,927.00 | 0.35 |
| 80 | 605090 | 九丰能源 | 13,400 | 388,600.00 | 0.34 |
| 81 | 002456 | 欧菲光 | 48,800 | 381,128.00 | 0.33 |
| 82 | 002635 | 安洁科技 | 24,500 | 378,280.00 | 0.33 |
| 83 | 603906 | 龙蟠科技 | 48,500 | 377,815.00 | 0.33 |
| 84 | 002171 | 楚江新材 | 56,100 | 369,699.00 | 0.32 |
| 85 | 600641 | 万业企业 | 31,100 | 365,425.00 | 0.32 |
| 86 | 601369 | 陕鼓动力 | 45,300 | 363,306.00 | 0.32 |
| 87 | 002283 | 天润工业 | 84,000 | 360,360.00 | 0.31 |
| 88 | 300298 | 三诺生物 | 14,100 | 357,294.00 | 0.31 |
| 89 | 000528 | 柳工 | 31,700 | 354,723.00 | 0.31 |
| 90 | 000029 | 深深房 A | 33,300 | 353,979.00 | 0.31 |
| 91 | 002948 | 青岛银行 | 104,000 | 350,480.00 | 0.31 |
| 92 | 002847 | 盐津铺子 | 8,180 | 349,858.60 | 0.31 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 93 | 688798 | 艾为电子 | 6,138 | 347,533.56 | 0.30 |
| 94 | 002906 | 华阳集团 | 12,900 | 345,204.00 | 0.30 |
| 95 | 688596 | 正帆科技 | 10,438 | 344,454.00 | 0.30 |
| 96 | 688556 | 高测股份 | 28,595 | 339,994.55 | 0.30 |
| 97 | 001338 | 永顺泰 | 34,600 | 339,080.00 | 0.30 |
| 98 | 002127 | 南极电商 | 129,900 | 337,740.00 | 0.29 |
| 99 | 002126 | 银轮股份 | 19,300 | 336,013.00 | 0.29 |
| 100 | 603920 | 世运电路 | 16,900 | 333,606.00 | 0.29 |
| 101 | 300446 | 航天智造 | 27,800 | 330,820.00 | 0.29 |
| 102 | 300633 | 开立医疗 | 8,300 | 328,514.00 | 0.29 |
| 103 | 603267 | 鸿远电子 | 9,600 | 327,360.00 | 0.29 |
| 104 | 300856 | 科思股份 | 10,100 | 323,301.00 | 0.28 |
| 105 | 002154 | 报喜鸟 | 59,300 | 322,592.00 | 0.28 |
| 106 | 603533 | 掌阅科技 | 17,100 | 319,257.00 | 0.28 |
| 107 | 603505 | 金石资源 | 11,300 | 315,609.00 | 0.28 |
| 108 | 600323 | 瀚蓝环境 | 15,100 | 315,590.00 | 0.28 |
| 109 | 600710 | 苏美达 | 38,600 | 314,590.00 | 0.27 |
| 110 | 002701 | 奥瑞金 | 75,100 | 312,416.00 | 0.27 |
| 111 | 300587 | 天铁股份 | 76,100 | 307,444.00 | 0.27 |
| 112 | 000503 | 国新健康 | 45,800 | 305,486.00 | 0.27 |
| 113 | 688127 | 蓝特光学 | 16,497 | 303,379.83 | 0.26 |
| 114 | 601068 | 中铝国际 | 71,600 | 301,436.00 | 0.26 |
| 115 | 300113 | 顺网科技 | 29,400 | 301,056.00 | 0.26 |
| 116 | 300773 | 拉卡拉 | 24,100 | 299,563.00 | 0.26 |
| 117 | 688630 | 芯碁微装 | 4,779 | 299,022.03 | 0.26 |
| 118 | 600559 | 老白干酒 | 16,400 | 298,152.00 | 0.26 |
| 119 | 002312 | 川发龙蟒 | 44,300 | 298,139.00 | 0.26 |
| 120 | 300170 | 汉得信息 | 48,300 | 296,562.00 | 0.26 |
| 121 | 300183 | 东软载波 | 25,600 | 296,448.00 | 0.26 |
| 122 | 000065 | 北方国际 | 28,100 | 291,397.00 | 0.25 |
| 123 | 600461 | 洪城环境 | 25,100 | 290,658.00 | 0.25 |
| 124 | 002782 | 可立克 | 26,200 | 290,296.00 | 0.25 |
| 125 | 601222 | 林洋能源 | 46,100 | 289,047.00 | 0.25 |
| 126 | 000712 | 锦龙股份 | 38,500 | 288,750.00 | 0.25 |
| 127 | 300409 | 道氏技术 | 33,600 | 287,616.00 | 0.25 |
| 128 | 603132 | 金徽股份 | 20,800 | 286,208.00 | 0.25 |
| 129 | 300811 | 铂科新材 | 6,480 | 284,472.00 | 0.25 |
| 130 | 600648 | 外高桥 | 32,000 | 283,520.00 | 0.25 |
| 131 | 002048 | 宁波华翔 | 21,600 | 279,504.00 | 0.24 |
| 132 | 301171 | 易点天下 | 19,000 | 279,300.00 | 0.24 |
| 133 | 688167 | 炬光科技 | 5,016 | 275,880.00 | 0.24 |
| 134 | 002315 | 焦点科技 | 10,200 | 274,992.00 | 0.24 |
| 135 | 000923 | 河钢资源 | 15,900 | 273,798.00 | 0.24 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 136 | 002727 | 一心堂 | 18,100 | 273,129.00 | 0.24 |
| 137 | 002544 | 普天科技 | 14,600 | 272,874.00 | 0.24 |
| 138 | 688518 | 联赢激光 | 16,268 | 271,675.60 | 0.24 |
| 139 | 603565 | 中谷物流 | 30,900 | 270,066.00 | 0.24 |
| 140 | 000517 | 荣安地产 | 100,700 | 269,876.00 | 0.24 |
| 141 | 300596 | 利安隆 | 9,900 | 268,587.00 | 0.23 |
| 142 | 688046 | 药康生物 | 26,257 | 268,346.54 | 0.23 |
| 143 | 600007 | 中国国贸 | 12,200 | 267,912.00 | 0.23 |
| 144 | 002993 | 奥海科技 | 7,200 | 267,840.00 | 0.23 |
| 145 | 002192 | 融捷股份 | 8,900 | 267,178.00 | 0.23 |
| 146 | 688380 | 中微半导 | 15,963 | 266,901.36 | 0.23 |
| 147 | 002123 | 梦网科技 | 37,700 | 265,031.00 | 0.23 |
| 148 | 300133 | 华策影视 | 42,900 | 263,406.00 | 0.23 |
| 149 | 300236 | 上海新阳 | 8,400 | 261,576.00 | 0.23 |
| 150 | 000028 | 国药一致 | 8,100 | 261,063.00 | 0.23 |
| 151 | 600395 | 盘江股份 | 43,400 | 260,834.00 | 0.23 |
| 152 | 600729 | 重庆百货 | 11,600 | 259,376.00 | 0.23 |
| 153 | 600645 | 中源协和 | 16,100 | 259,210.00 | 0.23 |
| 154 | 601969 | 海南矿业 | 40,200 | 254,868.00 | 0.22 |
| 155 | 688586 | 江航装备 | 27,218 | 253,127.40 | 0.22 |
| 156 | 300366 | 创意信息 | 34,900 | 252,676.00 | 0.22 |
| 157 | 600810 | 神马股份 | 40,600 | 251,720.00 | 0.22 |
| 158 | 688598 | 金博股份 | 8,770 | 248,191.00 | 0.22 |
| 159 | 000403 | 派林生物 | 9,300 | 247,938.00 | 0.22 |
| 160 | 000030 | 富奥股份 | 50,300 | 246,973.00 | 0.22 |
| 161 | 600757 | 长江传媒 | 30,500 | 245,830.00 | 0.21 |
| 162 | 300772 | 运达股份 | 25,530 | 245,088.00 | 0.21 |
| 163 | 600295 | 鄂尔多斯 | 24,700 | 245,024.00 | 0.21 |
| 164 | 002737 | 葵花药业 | 10,400 | 243,152.00 | 0.21 |
| 165 | 603466 | 风语筑 | 28,400 | 242,536.00 | 0.21 |
| 166 | 688019 | 安集科技 | 1,924 | 242,039.20 | 0.21 |
| 167 | 603730 | 岱美股份 | 24,160 | 240,150.40 | 0.21 |
| 168 | 300416 | 苏试试验 | 18,600 | 239,196.00 | 0.21 |
| 169 | 603008 | 喜临门 | 13,700 | 237,421.00 | 0.21 |
| 170 | 300850 | 新强联 | 15,800 | 237,316.00 | 0.21 |
| 171 | 600586 | 金晶科技 | 40,500 | 234,900.00 | 0.20 |
| 172 | 300085 | 银之杰 | 29,000 | 234,320.00 | 0.20 |
| 173 | 000650 | 仁和药业 | 39,700 | 234,230.00 | 0.20 |
| 174 | 300065 | 海兰信 | 35,400 | 233,994.00 | 0.20 |
| 175 | 603323 | 苏农银行 | 48,600 | 233,766.00 | 0.20 |
| 176 | 601163 | 三角轮胎 | 15,300 | 232,866.00 | 0.20 |
| 177 | 301238 | 瑞泰新材 | 15,500 | 232,035.00 | 0.20 |
| 178 | 300369 | 绿盟科技 | 45,400 | 231,994.00 | 0.20 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 179 | 000567 | 海德股份 | 41,325 | 231,833.25 | 0.20 |
| 180 | 600123 | 兰花科创 | 25,900 | 231,805.00 | 0.20 |
| 181 | 603281 | 江瀚新材 | 10,320 | 231,684.00 | 0.20 |
| 182 | 300294 | 博雅生物 | 7,000 | 231,000.00 | 0.20 |
| 183 | 688033 | 天宜上佳 | 38,312 | 229,872.00 | 0.20 |
| 184 | 300363 | 博腾股份 | 19,200 | 229,440.00 | 0.20 |
| 185 | 603123 | 翠微股份 | 38,600 | 229,284.00 | 0.20 |
| 186 | 000062 | 深圳华强 | 25,600 | 227,840.00 | 0.20 |
| 187 | 300470 | 中密控股 | 6,700 | 226,527.00 | 0.20 |
| 188 | 601677 | 明泰铝业 | 19,500 | 225,420.00 | 0.20 |
| 189 | 002034 | 旺能环境 | 17,100 | 222,471.00 | 0.19 |
| 190 | 688800 | 瑞可达 | 7,920 | 222,393.60 | 0.19 |
| 191 | 688185 | 康希诺 | 5,400 | 221,886.00 | 0.19 |
| 192 | 301268 | 铭利达 | 14,200 | 220,810.00 | 0.19 |
| 193 | 002534 | 西子洁能 | 22,000 | 220,220.00 | 0.19 |
| 194 | 000915 | 华特达因 | 7,300 | 220,168.00 | 0.19 |
| 195 | 002967 | 广电计量 | 18,600 | 219,480.00 | 0.19 |
| 196 | 600057 | 厦门象屿 | 31,800 | 216,240.00 | 0.19 |
| 197 | 002212 | 天融信 | 44,400 | 216,228.00 | 0.19 |
| 198 | 300123 | 亚光科技 | 46,600 | 216,224.00 | 0.19 |
| 199 | 600557 | 康缘药业 | 13,700 | 215,090.00 | 0.19 |
| 200 | 688023 | 安恒信息 | 5,362 | 214,533.62 | 0.19 |
| 201 | 002335 | 科华数据 | 10,100 | 213,413.00 | 0.19 |
| 202 | 600874 | 创业环保 | 38,100 | 212,979.00 | 0.19 |
| 203 | 300910 | 瑞丰新材 | 4,800 | 209,856.00 | 0.18 |
| 204 | 301308 | 江波龙 | 2,200 | 208,428.00 | 0.18 |
| 205 | 000935 | 四川双马 | 17,000 | 204,170.00 | 0.18 |
| 206 | 300233 | 金城医药 | 13,600 | 202,912.00 | 0.18 |
| 207 | 301239 | 普瑞眼科 | 5,700 | 201,381.00 | 0.18 |
| 208 | 300735 | 光弘科技 | 9,300 | 200,880.00 | 0.18 |
| 209 | 601811 | 新华文轩 | 14,300 | 200,343.00 | 0.17 |
| 210 | 300685 | 艾德生物 | 11,300 | 199,332.00 | 0.17 |
| 211 | 002125 | 湘潭电化 | 20,400 | 198,492.00 | 0.17 |
| 212 | 300624 | 万兴科技 | 3,719 | 197,367.33 | 0.17 |
| 213 | 600888 | 新疆众和 | 27,700 | 195,839.00 | 0.17 |
| 214 | 002416 | 爱施德 | 22,100 | 195,585.00 | 0.17 |
| 215 | 002498 | 汉缆股份 | 58,800 | 193,452.00 | 0.17 |
| 216 | 600459 | 贵研铂业 | 14,200 | 191,842.00 | 0.17 |
| 217 | 600452 | 涪陵电力 | 15,100 | 191,317.00 | 0.17 |
| 218 | 000848 | 承德露露 | 24,300 | 190,998.00 | 0.17 |
| 219 | 600639 | 浦东金桥 | 18,700 | 190,927.00 | 0.17 |
| 220 | 000966 | 长源电力 | 42,900 | 189,189.00 | 0.17 |
| 221 | 301155 | 海力风电 | 4,700 | 189,081.00 | 0.16 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 222 | 603919 | 金徽酒 | 10,400 | 188,968.00 | 0.16 |
| 223 | 600618 | 氯碱化工 | 21,300 | 187,014.00 | 0.16 |
| 224 | 000719 | 中原传媒 | 18,000 | 181,980.00 | 0.16 |
| 225 | 000990 | 诚志股份 | 24,400 | 181,536.00 | 0.16 |
| 226 | 605333 | 沪光股份 | 6,400 | 178,240.00 | 0.16 |
| 227 | 688388 | 嘉元科技 | 18,147 | 176,933.25 | 0.15 |
| 228 | 603055 | 台华新材 | 17,100 | 173,223.00 | 0.15 |
| 229 | 300663 | 科蓝软件 | 17,300 | 170,751.00 | 0.15 |
| 230 | 300887 | 谱尼测试 | 22,500 | 166,500.00 | 0.15 |
| 231 | 002837 | 英维克 | 7,760 | 165,986.40 | 0.14 |
| 232 | 002320 | 海峡股份 | 31,700 | 163,572.00 | 0.14 |
| 233 | 600993 | 马应龙 | 6,100 | 162,687.00 | 0.14 |
| 234 | 300623 | 捷捷微电 | 9,400 | 162,620.00 | 0.14 |
| 235 | 300666 | 江丰电子 | 3,400 | 161,704.00 | 0.14 |
| 236 | 000913 | 钱江摩托 | 10,100 | 159,176.00 | 0.14 |
| 237 | 600643 | 爱建集团 | 41,500 | 156,455.00 | 0.14 |
| 238 | 603187 | 海容冷链 | 13,400 | 156,244.00 | 0.14 |
| 239 | 603197 | 保隆科技 | 4,900 | 154,350.00 | 0.13 |
| 240 | 002378 | 章源钨业 | 26,800 | 153,832.00 | 0.13 |
| 241 | 002275 | 桂林三金 | 12,200 | 151,402.00 | 0.13 |
| 242 | 600773 | 西藏城投 | 14,600 | 150,672.00 | 0.13 |
| 243 | 600458 | 时代新材 | 14,800 | 149,480.00 | 0.13 |
| 244 | 600869 | 远东股份 | 42,700 | 149,023.00 | 0.13 |
| 245 | 688484 | 南芯科技 | 3,987 | 147,917.70 | 0.13 |
| 246 | 600562 | 国睿科技 | 10,800 | 147,528.00 | 0.13 |
| 247 | 603733 | 仙鹤股份 | 8,300 | 145,914.00 | 0.13 |
| 248 | 601801 | 皖新传媒 | 20,800 | 144,144.00 | 0.13 |
| 249 | 002453 | 华软科技 | 33,100 | 141,999.00 | 0.12 |
| 250 | 600475 | 华光环能 | 16,300 | 141,973.00 | 0.12 |
| 251 | 000860 | 顺鑫农业 | 8,300 | 138,942.00 | 0.12 |
| 252 | 603877 | 太平鸟 | 10,100 | 138,673.00 | 0.12 |
| 253 | 688166 | 博瑞医药 | 3,940 | 137,900.00 | 0.12 |
| 254 | 600961 | 株冶集团 | 14,500 | 136,880.00 | 0.12 |
| 255 | 002941 | 新疆交建 | 13,700 | 136,726.00 | 0.12 |
| 256 | 600409 | 三友化工 | 27,200 | 136,544.00 | 0.12 |
| 257 | 002239 | 奥特佳 | 57,600 | 132,480.00 | 0.12 |
| 258 | 688608 | 恒玄科技 | 900 | 131,742.00 | 0.11 |
| 259 | 688208 | 道通科技 | 5,438 | 131,273.32 | 0.11 |
| 260 | 300857 | 协创数据 | 2,300 | 131,100.00 | 0.11 |
| 261 | 688239 | 航宇科技 | 3,760 | 130,848.00 | 0.11 |
| 262 | 600206 | 有研新材 | 14,700 | 130,830.00 | 0.11 |
| 263 | 600877 | 电科芯片 | 12,100 | 129,712.00 | 0.11 |
| 264 | 300894 | 火星人 | 10,100 | 129,482.00 | 0.11 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 265 | 002292 | 奥飞娱乐 | 21,600 | 129,168.00 | 0.11 |
| 266 | 600623 | 华谊集团 | 22,300 | 128,894.00 | 0.11 |
| 267 | 000928 | 中钢国际 | 23,200 | 128,760.00 | 0.11 |
| 268 | 601595 | 上海电影 | 6,500 | 128,570.00 | 0.11 |
| 269 | 301217 | 铜冠铜箔 | 13,200 | 126,720.00 | 0.11 |
| 270 | 603236 | 移远通信 | 2,700 | 126,171.00 | 0.11 |
| 271 | 601001 | 晋控煤业 | 7,600 | 125,552.00 | 0.11 |
| 272 | 600391 | 航发科技 | 8,200 | 125,050.00 | 0.11 |
| 273 | 300693 | 盛弘股份 | 5,900 | 123,546.00 | 0.11 |
| 274 | 300770 | 新媒股份 | 3,700 | 123,506.00 | 0.11 |
| 275 | 688327 | 云从科技 | 10,825 | 122,430.75 | 0.11 |
| 276 | 600572 | 康恩贝 | 27,100 | 121,137.00 | 0.11 |
| 277 | 000035 | 中国天楹 | 26,700 | 120,951.00 | 0.11 |
| 278 | 002023 | 海特高新 | 13,000 | 118,950.00 | 0.10 |
| 279 | 600100 | 同方股份 | 23,100 | 117,579.00 | 0.10 |
| 280 | 002043 | 兔宝宝 | 11,000 | 114,070.00 | 0.10 |
| 281 | 002777 | 久远银海 | 7,600 | 113,924.00 | 0.10 |
| 282 | 600223 | 福瑞达 | 16,100 | 113,827.00 | 0.10 |
| 283 | 688037 | 芯源微 | 1,261 | 112,229.00 | 0.10 |
| 284 | 603013 | 亚普股份 | 8,300 | 111,801.00 | 0.10 |
| 285 | 301316 | 慧博云通 | 7,600 | 111,568.00 | 0.10 |
| 286 | 600428 | 中远海特 | 18,000 | 110,160.00 | 0.10 |
| 287 | 688711 | 宏微科技 | 6,779 | 108,870.74 | 0.09 |
| 288 | 600601 | 方正科技 | 36,200 | 108,600.00 | 0.09 |
| 289 | 603489 | 八方股份 | 4,000 | 107,920.00 | 0.09 |
| 290 | 002003 | 伟星股份 | 8,500 | 106,675.00 | 0.09 |
| 291 | 600750 | 江中药业 | 4,600 | 106,306.00 | 0.09 |
| 292 | 300687 | 赛意信息 | 7,500 | 104,400.00 | 0.09 |
| 293 | 300180 | 华峰超纤 | 29,400 | 103,782.00 | 0.09 |
| 294 | 601860 | 紫金银行 | 40,900 | 102,250.00 | 0.09 |
| 295 | 600929 | 雪天盐业 | 18,700 | 99,110.00 | 0.09 |
| 296 | 000810 | 创维数字 | 11,500 | 98,670.00 | 0.09 |
| 297 | 688789 | 宏华数科 | 900 | 97,020.00 | 0.08 |
| 298 | 600864 | 哈投股份 | 20,300 | 96,425.00 | 0.08 |
| 299 | 603100 | 川仪股份 | 4,100 | 96,391.00 | 0.08 |
| 300 | 002851 | 麦格米特 | 3,700 | 95,608.00 | 0.08 |
| 301 | 002891 | 中宠股份 | 4,400 | 91,828.00 | 0.08 |
| 302 | 600502 | 安徽建工 | 21,200 | 91,160.00 | 0.08 |
| 303 | 002174 | 游族网络 | 11,900 | 90,321.00 | 0.08 |
| 304 | 002911 | 佛燃能源 | 9,600 | 87,744.00 | 0.08 |
| 305 | 001269 | 欧晶科技 | 3,100 | 86,180.00 | 0.08 |
| 306 | 688091 | 上海谊众 | 3,711 | 83,831.49 | 0.07 |
| 307 | 601609 | 金田股份 | 14,500 | 82,070.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 308 | 600835 | 上海机电 | 7,100 | 81,721.00 | 0.07 |
| 309 | 688707 | 振华新材 | 8,387 | 81,689.38 | 0.07 |
| 310 | 600216 | 浙江医药 | 7,400 | 81,252.00 | 0.07 |
| 311 | 002270 | 华明装备 | 3,600 | 80,064.00 | 0.07 |
| 312 | 300346 | 南大光电 | 2,800 | 80,052.00 | 0.07 |
| 313 | 002840 | 华统股份 | 4,700 | 77,973.00 | 0.07 |
| 314 | 300620 | 光库科技 | 2,100 | 77,238.00 | 0.07 |
| 315 | 601918 | 新集能源 | 7,900 | 77,025.00 | 0.07 |
| 316 | 300660 | 江苏雷利 | 3,000 | 76,560.00 | 0.07 |
| 317 | 603936 | 博敏电子 | 9,100 | 76,440.00 | 0.07 |
| 318 | 000682 | 东方电子 | 6,900 | 76,176.00 | 0.07 |
| 319 | 000426 | 兴业银锡 | 5,600 | 76,048.00 | 0.07 |
| 320 | 002745 | 木林森 | 9,200 | 74,152.00 | 0.06 |
| 321 | 603678 | 火炬电子 | 3,000 | 74,070.00 | 0.06 |
| 322 | 600211 | 西藏药业 | 2,260 | 73,630.80 | 0.06 |
| 323 | 002097 | 山河智能 | 12,200 | 73,566.00 | 0.06 |
| 324 | 603915 | 国茂股份 | 7,100 | 73,059.00 | 0.06 |
| 325 | 603567 | 珍宝岛 | 6,900 | 72,657.00 | 0.06 |
| 326 | 688106 | 金宏气体 | 4,122 | 72,217.44 | 0.06 |
| 327 | 603595 | 东尼电子 | 3,500 | 72,065.00 | 0.06 |
| 328 | 603113 | 金能科技 | 13,100 | 71,657.00 | 0.06 |
| 329 | 002405 | 四维图新 | 11,500 | 71,530.00 | 0.06 |
| 330 | 002545 | 东方铁塔 | 10,500 | 71,505.00 | 0.06 |
| 331 | 600120 | 浙江东方 | 21,400 | 71,476.00 | 0.06 |
| 332 | 603690 | 至纯科技 | 3,100 | 71,331.00 | 0.06 |
| 333 | 603129 | 春风动力 | 500 | 71,170.00 | 0.06 |
| 334 | 002091 | 江苏国泰 | 10,400 | 70,824.00 | 0.06 |
| 335 | 600596 | 新安股份 | 9,300 | 70,680.00 | 0.06 |
| 336 | 688559 | 海目星 | 2,140 | 70,384.60 | 0.06 |
| 337 | 600210 | 紫江企业 | 13,200 | 70,224.00 | 0.06 |
| 338 | 600577 | 精达股份 | 17,500 | 69,475.00 | 0.06 |
| 339 | 688639 | 华恒生物 | 900 | 68,751.00 | 0.06 |
| 340 | 688202 | 美迪西 | 2,635 | 68,641.75 | 0.06 |
| 341 | 000429 | 粤高速 A | 6,500 | 67,665.00 | 0.06 |
| 342 | 000970 | 中科三环 | 8,800 | 67,320.00 | 0.06 |
| 343 | 688088 | 虹软科技 | 2,306 | 66,551.16 | 0.06 |
| 344 | 300579 | 数字认证 | 3,400 | 66,300.00 | 0.06 |
| 345 | 000837 | 秦川机床 | 9,000 | 66,240.00 | 0.06 |
| 346 | 002925 | 盈趣科技 | 5,200 | 65,884.00 | 0.06 |
| 347 | 002250 | 联化科技 | 13,700 | 65,760.00 | 0.06 |
| 348 | 300741 | 华宝股份 | 4,300 | 65,532.00 | 0.06 |
| 349 | 600073 | 光明肉业 | 11,800 | 65,018.00 | 0.06 |
| 350 | 002960 | 青鸟消防 | 5,100 | 64,464.00 | 0.06 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 351 | 300206 | 理邦仪器 | 7,500 | 64,425.00 | 0.06 |
| 352 | 300166 | 东方国信 | 10,500 | 64,260.00 | 0.06 |
| 353 | 600575 | 淮河能源 | 16,500 | 64,185.00 | 0.06 |
| 354 | 300079 | 数码视讯 | 15,800 | 64,148.00 | 0.06 |
| 355 | 000657 | 中钨高新 | 7,000 | 63,980.00 | 0.06 |
| 356 | 688362 | 甬矽电子 | 3,287 | 63,965.02 | 0.06 |
| 357 | 300398 | 飞凯材料 | 5,200 | 63,960.00 | 0.06 |
| 358 | 603983 | 丸美股份 | 2,300 | 63,319.00 | 0.06 |
| 359 | 002214 | 大立科技 | 5,600 | 63,168.00 | 0.06 |
| 360 | 300820 | 英杰电气 | 1,600 | 62,944.00 | 0.05 |
| 361 | 002151 | 北斗星通 | 2,600 | 62,868.00 | 0.05 |
| 362 | 688110 | 东芯股份 | 3,287 | 62,683.09 | 0.05 |
| 363 | 600597 | 光明乳业 | 8,000 | 62,160.00 | 0.05 |
| 364 | 000727 | 冠捷科技 | 30,100 | 62,006.00 | 0.05 |
| 365 | 300598 | 诚迈科技 | 2,200 | 61,776.00 | 0.05 |
| 366 | 688289 | 圣湘生物 | 3,483 | 61,231.14 | 0.05 |
| 367 | 603103 | 横店影视 | 4,400 | 60,896.00 | 0.05 |
| 368 | 600751 | 海航科技 | 27,000 | 59,940.00 | 0.05 |
| 369 | 600248 | 陕建股份 | 16,500 | 59,895.00 | 0.05 |
| 370 | 002467 | 二六三 | 17,600 | 58,784.00 | 0.05 |
| 371 | 002063 | 远光软件 | 11,200 | 58,688.00 | 0.05 |
| 372 | 601101 | 昊华能源 | 6,300 | 57,897.00 | 0.05 |
| 373 | 601890 | 亚星锚链 | 8,200 | 57,810.00 | 0.05 |
| 374 | 600201 | 生物股份 | 8,000 | 57,680.00 | 0.05 |
| 375 | 001213 | 中铁特货 | 14,400 | 56,880.00 | 0.05 |
| 376 | 688366 | 昊海生科 | 920 | 56,745.60 | 0.05 |
| 377 | 000795 | 英洛华 | 10,200 | 56,508.00 | 0.05 |
| 378 | 301205 | 联特科技 | 900 | 56,475.00 | 0.05 |
| 379 | 002243 | 力合科创 | 10,200 | 56,406.00 | 0.05 |
| 380 | 300315 | 掌趣科技 | 13,500 | 56,295.00 | 0.05 |
| 381 | 601038 | 一拖股份 | 3,500 | 55,335.00 | 0.05 |
| 382 | 002697 | 红旗连锁 | 11,900 | 55,097.00 | 0.05 |
| 383 | 600776 | 东方通信 | 5,600 | 55,048.00 | 0.05 |
| 384 | 002516 | 旷达科技 | 15,000 | 54,600.00 | 0.05 |
| 385 | 688381 | 帝奥微 | 2,796 | 54,466.08 | 0.05 |
| 386 | 002488 | 金固股份 | 12,400 | 54,436.00 | 0.05 |
| 387 | 002053 | 云南能投 | 4,500 | 54,405.00 | 0.05 |
| 388 | 002004 | 华邦健康 | 14,300 | 54,340.00 | 0.05 |
| 389 | 688232 | 新点软件 | 2,749 | 54,210.28 | 0.05 |
| 390 | 688177 | 百奥泰 | 2,557 | 54,003.84 | 0.05 |
| 391 | 600662 | 外服控股 | 13,400 | 53,734.00 | 0.05 |
| 392 | 300045 | 华力创通 | 3,000 | 52,950.00 | 0.05 |
| 393 | 300618 | 寒锐钴业 | 2,000 | 52,900.00 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 394 | 688209 | 英集芯 | 4,246 | 52,692.86 | 0.05 |
| 395 | 600075 | 新疆天业 | 15,200 | 52,440.00 | 0.05 |
| 395 | 601778 | 晶科科技 | 23,000 | 52,440.00 | 0.05 |
| 396 | 002643 | 万润股份 | 5,200 | 52,000.00 | 0.05 |
| 397 | 000813 | 德展健康 | 24,900 | 51,792.00 | 0.05 |
| 398 | 688031 | 星环科技 | 1,400 | 51,394.00 | 0.04 |
| 399 | 688336 | 三生国健 | 2,513 | 51,139.55 | 0.04 |
| 400 | 600976 | 健民集团 | 1,000 | 50,500.00 | 0.04 |
| 401 | 001914 | 招商积余 | 5,000 | 50,100.00 | 0.04 |
| 402 | 688776 | 国光电气 | 900 | 49,860.00 | 0.04 |
| 403 | 603439 | 贵州三力 | 3,900 | 49,764.00 | 0.04 |
| 404 | 003040 | 楚天龙 | 4,000 | 49,200.00 | 0.04 |
| 405 | 002901 | 大博医疗 | 1,900 | 49,077.00 | 0.04 |
| 406 | 603609 | 禾丰股份 | 7,500 | 49,050.00 | 0.04 |
| 407 | 002145 | 中核钛白 | 14,900 | 48,872.00 | 0.04 |
| 408 | 688173 | 希荻微 | 4,398 | 48,509.94 | 0.04 |
| 409 | 603297 | 永新光学 | 800 | 48,392.00 | 0.04 |
| 410 | 002176 | 江特电机 | 5,900 | 48,085.00 | 0.04 |
| 411 | 603299 | 苏盐井神 | 5,000 | 47,500.00 | 0.04 |
| 412 | 603989 | 艾华集团 | 3,300 | 46,398.00 | 0.04 |
| 413 | 688235 | 百济神州 | 400 | 46,336.00 | 0.04 |
| 414 | 601869 | 长飞光纤 | 1,900 | 46,227.00 | 0.04 |
| 415 | 603093 | 南华期货 | 5,300 | 45,898.00 | 0.04 |
| 416 | 000969 | 安泰科技 | 5,600 | 44,408.00 | 0.04 |
| 417 | 601952 | 苏垦农发 | 4,900 | 44,198.00 | 0.04 |
| 418 | 600971 | 恒源煤电 | 3,700 | 44,178.00 | 0.04 |
| 419 | 603766 | 隆鑫通用 | 6,500 | 44,070.00 | 0.04 |
| 420 | 000811 | 冰轮环境 | 4,500 | 43,425.00 | 0.04 |
| 421 | 688680 | 海优新材 | 1,500 | 43,110.00 | 0.04 |
| 422 | 688278 | 特宝生物 | 800 | 42,840.00 | 0.04 |
| 423 | 300613 | 富瀚微 | 1,300 | 42,783.00 | 0.04 |
| 424 | 603063 | 禾望电气 | 2,700 | 41,391.00 | 0.04 |
| 425 | 603005 | 晶方科技 | 2,000 | 40,760.00 | 0.04 |
| 426 | 601777 | 力帆科技 | 10,500 | 40,320.00 | 0.04 |
| 427 | 300049 | 福瑞股份 | 800 | 40,272.00 | 0.04 |
| 428 | 002390 | 信邦制药 | 12,100 | 40,051.00 | 0.03 |
| 429 | 001236 | 弘业期货 | 5,500 | 39,105.00 | 0.03 |
| 430 | 002626 | 金达威 | 2,700 | 39,015.00 | 0.03 |
| 431 | 000875 | 吉电股份 | 7,000 | 37,310.00 | 0.03 |
| 432 | 688408 | 中信博 | 400 | 36,832.00 | 0.03 |
| 433 | 002079 | 苏州固锝 | 4,300 | 36,636.00 | 0.03 |
| 434 | 600012 | 皖通高速 | 2,600 | 36,322.00 | 0.03 |
| 435 | 688083 | 中望软件 | 500 | 36,310.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 436 | 000917 | 电广传媒 | 7,100 | 35,855.00 | 0.03 |
| 437 | 002597 | 金禾实业 | 1,800 | 35,802.00 | 0.03 |
| 438 | 002747 | 埃斯顿 | 2,500 | 35,550.00 | 0.03 |
| 439 | 300674 | 宇信科技 | 3,100 | 34,348.00 | 0.03 |
| 440 | 300415 | 伊之密 | 1,600 | 33,248.00 | 0.03 |
| 441 | 000902 | 新洋丰 | 2,800 | 33,236.00 | 0.03 |
| 442 | 688322 | 奥比中光 | 1,200 | 32,052.00 | 0.03 |
| 443 | 000543 | 皖能电力 | 3,600 | 31,860.00 | 0.03 |
| 444 | 600151 | 航天机电 | 7,000 | 31,640.00 | 0.03 |
| 445 | 601069 | 西部黄金 | 2,700 | 31,401.00 | 0.03 |
| 446 | 300109 | 新开源 | 2,700 | 31,266.00 | 0.03 |
| 447 | 300134 | 大富科技 | 4,500 | 30,690.00 | 0.03 |
| 448 | 002946 | 新乳业 | 3,500 | 30,660.00 | 0.03 |
| 449 | 600449 | 宁夏建材 | 2,600 | 30,550.00 | 0.03 |
| 450 | 688027 | 国盾量子 | 200 | 30,200.00 | 0.03 |
| 451 | 300456 | 赛微电子 | 1,900 | 30,153.00 | 0.03 |
| 452 | 002011 | 盾安环境 | 3,000 | 29,490.00 | 0.03 |
| 453 | 603383 | 顶点软件 | 900 | 28,863.00 | 0.03 |
| 454 | 300031 | 宝通科技 | 2,000 | 28,740.00 | 0.03 |
| 455 | 600812 | 华北制药 | 6,700 | 27,604.00 | 0.02 |
| 456 | 600667 | 太极实业 | 4,700 | 26,837.00 | 0.02 |
| 457 | 688400 | 凌云光 | 1,600 | 26,688.00 | 0.02 |
| 458 | 603995 | 甬金股份 | 1,500 | 26,280.00 | 0.02 |
| 459 | 300525 | 博思软件 | 2,000 | 25,400.00 | 0.02 |
| 460 | 688116 | 天奈科技 | 1,100 | 25,388.00 | 0.02 |
| 461 | 300634 | 彩讯股份 | 1,500 | 25,245.00 | 0.02 |
| 462 | 300101 | 振芯科技 | 1,700 | 25,109.00 | 0.02 |
| 463 | 001696 | 宗申动力 | 2,300 | 24,472.00 | 0.02 |
| 464 | 002991 | 甘源食品 | 400 | 24,260.00 | 0.02 |
| 465 | 300284 | 苏交科 | 3,000 | 24,240.00 | 0.02 |
| 466 | 300115 | 长盈精密 | 2,000 | 23,980.00 | 0.02 |
| 467 | 600761 | 安徽合力 | 1,100 | 23,804.00 | 0.02 |
| 468 | 601311 | 骆驼股份 | 2,900 | 23,258.00 | 0.02 |
| 469 | 600446 | 金证股份 | 2,300 | 22,839.00 | 0.02 |
| 470 | 300035 | 中科电气 | 2,600 | 22,126.00 | 0.02 |
| 471 | 603871 | 嘉友国际 | 1,240 | 21,935.60 | 0.02 |
| 472 | 688048 | 长光华芯 | 700 | 21,868.00 | 0.02 |
| 473 | 300182 | 捷成股份 | 5,800 | 21,518.00 | 0.02 |
| 474 | 002077 | 大港股份 | 1,800 | 21,456.00 | 0.02 |
| 475 | 002402 | 和而泰 | 2,000 | 21,420.00 | 0.02 |
| 476 | 001270 | 铖昌科技 | 580 | 21,297.60 | 0.02 |
| 477 | 601949 | 中国出版 | 3,500 | 20,685.00 | 0.02 |
| 478 | 000881 | 中广核技 | 3,200 | 20,608.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 479 | 300428 | 立中集团 | 1,100 | 20,449.00 | 0.02 |
| 480 | 300229 | 拓尔思 | 1,500 | 20,145.00 | 0.02 |
| 481 | 603719 | 良品铺子 | 1,700 | 19,839.00 | 0.02 |
| 482 | 688351 | 微电生理 | 900 | 19,836.00 | 0.02 |
| 483 | 688321 | 微芯生物 | 1,100 | 19,360.00 | 0.02 |
| 484 | 000090 | 天健集团 | 4,800 | 19,296.00 | 0.02 |
| 485 | 603039 | 泛微网络 | 600 | 19,056.00 | 0.02 |
| 486 | 603308 | 应流股份 | 1,500 | 18,630.00 | 0.02 |
| 487 | 688502 | 茂莱光学 | 200 | 18,602.00 | 0.02 |
| 488 | 603530 | 神马电力 | 700 | 18,543.00 | 0.02 |
| 489 | 002605 | 姚记科技 | 900 | 18,378.00 | 0.02 |
| 490 | 600456 | 宝钛股份 | 700 | 17,871.00 | 0.02 |
| 491 | 300232 | 洲明科技 | 3,300 | 17,226.00 | 0.02 |
| 491 | 688270 | 臻镭科技 | 660 | 17,226.00 | 0.02 |
| 492 | 002978 | 安宁股份 | 600 | 16,716.00 | 0.01 |
| 493 | 002099 | 海翔药业 | 3,200 | 16,352.00 | 0.01 |
| 494 | 000681 | 视觉中国 | 1,200 | 13,800.00 | 0.01 |
| 495 | 000801 | 四川九洲 | 1,300 | 13,000.00 | 0.01 |
| 496 | 002549 | 凯美特气 | 2,500 | 12,775.00 | 0.01 |
| 497 | 600328 | 中盐化工 | 1,700 | 11,662.00 | 0.01 |
| 498 | 002317 | 众生药业 | 1,000 | 11,430.00 | 0.01 |
| 499 | 600861 | 北京人力 | 700 | 11,424.00 | 0.01 |
| 500 | 688389 | 普门科技 | 700 | 11,382.00 | 0.01 |
| 501 | 688503 | 聚和材料 | 400 | 11,240.00 | 0.01 |
| 502 | 601015 | 陕西黑猫 | 4,000 | 11,200.00 | 0.01 |
| 503 | 300151 | 昌红科技 | 700 | 11,074.00 | 0.01 |
| 504 | 688409 | 富创精密 | 296 | 10,934.24 | 0.01 |
| 505 | 600850 | 电科数字 | 600 | 10,860.00 | 0.01 |
| 506 | 600633 | 浙数文化 | 1,200 | 10,572.00 | 0.01 |
| 507 | 002287 | 奇正藏药 | 500 | 9,790.00 | 0.01 |
| 508 | 600195 | 中牧股份 | 1,300 | 9,737.00 | 0.01 |
| 509 | 002041 | 登海种业 | 1,200 | 9,696.00 | 0.01 |
| 510 | 300077 | 国民技术 | 1,000 | 8,730.00 | 0.01 |
| 511 | 603699 | 纽威股份 | 500 | 8,560.00 | 0.01 |
| 512 | 603301 | 振德医疗 | 400 | 8,344.00 | 0.01 |
| 513 | 688007 | 光峰科技 | 500 | 8,050.00 | 0.01 |
| 514 | 603027 | 千禾味业 | 600 | 7,980.00 | 0.01 |
| 515 | 002085 | 万丰奥威 | 600 | 7,944.00 | 0.01 |
| 516 | 688152 | 麒麟信安 | 200 | 7,744.00 | 0.01 |
| 517 | 003009 | 中天火箭 | 200 | 7,736.00 | 0.01 |
| 518 | 300443 | 金雷股份 | 500 | 7,665.00 | 0.01 |
| 519 | 688403 | 汇成股份 | 900 | 7,632.00 | 0.01 |
| 520 | 688100 | 威胜信息 | 200 | 7,630.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 521 | 002428 | 云南锗业 | 700 | 7,602.00 | 0.01 |
| 522 | 300261 | 雅本化学 | 1,400 | 7,420.00 | 0.01 |
| 523 | 002258 | 利尔化学 | 900 | 7,218.00 | 0.01 |
| 524 | 300039 | 上海凯宝 | 1,300 | 6,955.00 | 0.01 |
| 525 | 301558 | 三态股份 | 800 | 6,712.00 | 0.01 |
| 526 | 688686 | 奥普特 | 100 | 6,403.00 | 0.01 |
| 527 | 301089 | 拓新药业 | 200 | 5,934.00 | 0.01 |
| 528 | 603098 | 森特股份 | 700 | 5,502.00 | 0.00 |
| 529 | 003006 | 百亚股份 | 200 | 4,740.00 | 0.00 |
| 530 | 600335 | 国机汽车 | 800 | 4,616.00 | 0.00 |
| 531 | 003021 | 兆威机电 | 100 | 4,615.00 | 0.00 |
| 532 | 300432 | 富临精工 | 600 | 3,864.00 | 0.00 |
| 533 | 603128 | 华贸物流 | 500 | 2,885.00 | 0.00 |
| 534 | 600330 | 天通股份 | 400 | 2,720.00 | 0.00 |
| 535 | 600055 | 万东医疗 | 200 | 2,470.00 | 0.00 |
| 536 | 688739 | 成大生物 | 100 | 2,424.00 | 0.00 |
| 537 | 300382 | 斯莱克 | 400 | 2,364.00 | 0.00 |
| 538 | 000869 | 张裕 A | 100 | 2,135.00 | 0.00 |
| 539 | 002302 | 西部建设 | 400 | 2,080.00 | 0.00 |
| 540 | 600252 | 中恒集团 | 700 | 1,519.00 | 0.00 |
| 541 | 600602 | 云赛智联 | 100 | 1,104.00 | 0.00 |
| 542 | 002646 | 天佑德酒 | 100 | 1,023.00 | 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 | 600642 | 申能股份 | 5,700 | 50,331.00 | 0.04 |
| 2 | 300054 | 鼎龙股份 | 2,200 | 49,896.00 | 0.04 |
| 3 | 603160 | 汇顶科技 | 700 | 48,125.00 | 0.04 |
| 4 | 600284 | 浦东建设 | 8,800 | 46,992.00 | 0.04 |
| 5 | 603087 | 甘李药业 | 1,000 | 46,320.00 | 0.04 |
| 6 | 601636 | 旗滨集团 | 7,100 | 45,795.00 | 0.04 |
| 7 | 000921 | 海信家电 | 1,400 | 45,136.00 | 0.04 |
| 8 | 002558 | 巨人网络 | 4,700 | 44,368.00 | 0.04 |
| 9 | 688176 | 亚虹医药 | 8,645 | 44,175.95 | 0.04 |
| 10 | 000975 | 银泰黄金 | 2,700 | 43,983.00 | 0.04 |
| 11 | 300144 | 宋城演艺 | 5,200 | 41,756.00 | 0.04 |
| 12 | 688095 | 福昕软件 | 900 | 41,229.00 | 0.04 |
| 13 | 688371 | 菲沃泰 | 4,016 | 40,320.64 | 0.04 |
| 14 | 601717 | 郑煤机 | 2,700 | 39,960.00 | 0.03 |
| 15 | 300002 | 神州泰岳 | 4,700 | 38,164.00 | 0.03 |
| 16 | 002106 | 莱宝高科 | 3,400 | 37,060.00 | 0.03 |
| 17 | 688063 | 派能科技 | 920 | 36,533.20 | 0.03 |
| 18 | 601127 | 赛力斯 | 400 | 36,448.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 19 | 002517 | 恺英网络 | 2,400 | 22,920.00 | 0.02 |
| 20 | 688153 | 唯捷创芯 | 600 | 22,200.00 | 0.02 |
| 21 | 688787 | 海天瑞声 | 400 | 21,952.00 | 0.02 |
| 22 | 688099 | 晶晨股份 | 300 | 17,796.00 | 0.02 |
| 23 | 300662 | 科锐国际 | 1,100 | 17,743.00 | 0.02 |
| 24 | 603350 | 安乃达 | 858 | 17,640.48 | 0.02 |
| 25 | 688311 | 盟升电子 | 800 | 16,392.00 | 0.01 |
| 26 | 603285 | 键邦股份 | 847 | 15,796.55 | 0.01 |
| 27 | 002465 | 海格通信 | 1,500 | 15,540.00 | 0.01 |
| 28 | 605116 | 奥锐特 | 600 | 15,018.00 | 0.01 |
| 29 | 600529 | 山东药玻 | 500 | 12,670.00 | 0.01 |
| 30 | 600737 | 中粮糖业 | 1,200 | 11,508.00 | 0.01 |
| 31 | 603198 | 迎驾贡酒 | 200 | 11,500.00 | 0.01 |
| 32 | 688692 | 达梦数据 | 60 | 10,495.80 | 0.01 |
| 33 | 300571 | 平治信息 | 500 | 10,470.00 | 0.01 |
| 34 | 301392 | 汇成真空 | 219 | 9,123.54 | 0.01 |
| 35 | 000612 | 焦作万方 | 1,400 | 9,100.00 | 0.01 |
| 36 | 002724 | 海洋王 | 2,000 | 8,900.00 | 0.01 |
| 37 | 301536 | 星辰科技 | 273 | 8,809.71 | 0.01 |
| 38 | 600707 | 彩虹股份 | 1,200 | 8,172.00 | 0.01 |
| 39 | 688233 | 神工股份 | 400 | 7,708.00 | 0.01 |
| 40 | 688691 | 灿芯股份 | 181 | 7,694.31 | 0.01 |
| 41 | 301565 | 中仑新材 | 386 | 7,326.28 | 0.01 |
| 42 | 301539 | 宏鑫科技 | 361 | 7,155.02 | 0.01 |
| 43 | 002903 | 宇环数控 | 400 | 6,988.00 | 0.01 |
| 44 | 301566 | 达利凯普 | 395 | 6,703.15 | 0.01 |
| 45 | 603032 | 德新科技 | 500 | 5,715.00 | 0.00 |
| 46 | 300567 | 精测电子 | 100 | 5,651.00 | 0.00 |
| 47 | 688530 | 欧莱新材 | 344 | 5,538.40 | 0.00 |
| 48 | 301588 | 美新科技 | 254 | 5,397.50 | 0.00 |
| 49 | 688709 | 成都华微 | 269 | 5,054.51 | 0.00 |
| 50 | 301587 | 中瑞股份 | 196 | 4,950.96 | 0.00 |
| 51 | 603658 | 安图生物 | 100 | 4,607.00 | 0.00 |
| 52 | 688695 | 中创股份 | 146 | 4,606.30 | 0.00 |
| 53 | 001389 | 广合科技 | 132 | 4,561.92 | 0.00 |
| 54 | 688221 | 前沿生物 | 800 | 4,440.00 | 0.00 |
| 55 | 603341 | 龙旗科技 | 76 | 2,849.24 | 0.00 |
| 56 | 603082 | 北自科技 | 71 | 2,093.79 | 0.00 |
| 57 | 603344 | 星德胜 | 89 | 2,016.74 | 0.00 |
| 58 | 603381 | 永臻股份 | 74 | 1,859.62 | 0.00 |
| 59 | 300251 | 光线传媒 | 200 | 1,682.00 | 0.00 |
| 60 | 603375 | 盛景微 | 43 | 1,672.70 | 0.00 |
| 61 | 603325 | 博隆技术 | 23 | 1,565.38 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 62 | 001379 | 腾达科技 | 107 | 1,442.36 | 0.00 |
| 63 | 603312 | 西典新能 | 54 | 1,369.44 | 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 | 605589 | 圣泉集团 | 2,881,247.00 | 1.92 |
| 2 | 600667 | 太极实业 | 2,572,571.00 | 1.72 |
| 3 | 300770 | 新媒股份 | 2,293,068.00 | 1.53 |
| 4 | 002100 | 天康生物 | 2,264,506.00 | 1.51 |
| 5 | 000921 | 海信家电 | 2,256,660.00 | 1.50 |
| 6 | 601126 | 四方股份 | 2,210,095.00 | 1.47 |
| 7 | 300573 | 兴齐眼药 | 2,202,700.00 | 1.47 |
| 8 | 301219 | 腾远钴业 | 2,198,211.00 | 1.47 |
| 9 | 300002 | 神州泰岳 | 2,189,729.00 | 1.46 |
| 10 | 300803 | 指南针 | 2,186,574.00 | 1.46 |
| 11 | 002171 | 楚江新材 | 2,146,074.00 | 1.43 |
| 12 | 300841 | 康华生物 | 2,143,576.00 | 1.43 |
| 13 | 002706 | 良信股份 | 2,102,061.00 | 1.40 |
| 14 | 600718 | 东软集团 | 2,096,620.00 | 1.40 |
| 15 | 002318 | 久立特材 | 2,091,709.00 | 1.39 |
| 16 | 600710 | 苏美达 | 2,065,260.46 | 1.38 |
| 17 | 688158 | 优刻得 | 2,038,002.81 | 1.36 |
| 18 | 002979 | 雷赛智能 | 2,018,425.00 | 1.35 |
| 19 | 603666 | 亿嘉和 | 1,980,451.12 | 1.32 |
| 20 | 300451 | 创业慧康 | 1,970,216.00 | 1.31 |

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 | 600667 | 太极实业 | 3,133,805.00 | 2.09 |
| 2 | 002130 | 沃尔核材 | 2,828,771.00 | 1.89 |
| 3 | 000921 | 海信家电 | 2,796,447.00 | 1.86 |
| 4 | 600100 | 同方股份 | 2,442,789.00 | 1.63 |
| 5 | 600872 | 中炬高新 | 2,343,965.00 | 1.56 |
| 6 | 605589 | 圣泉集团 | 2,305,714.20 | 1.54 |
| 7 | 688235 | 百济神州 | 2,275,577.05 | 1.52 |
| 8 | 300803 | 指南针 | 2,242,200.00 | 1.49 |
| 9 | 600312 | 平高电气 | 2,171,180.14 | 1.45 |
| 10 | 000560 | 我爱我家 | 2,138,475.00 | 1.43 |
| 11 | 601137 | 博威合金 | 2,128,648.00 | 1.42 |
| 12 | 601126 | 四方股份 | 2,123,042.00 | 1.42 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 13 | 300458 | 全志科技 | 2,108,506.00 | 1.41 |
| 14 | 300170 | 汉得信息 | 2,096,665.00 | 1.40 |
| 15 | 301219 | 腾远钴业 | 2,091,108.00 | 1.39 |
| 16 | 600710 | 苏美达 | 2,061,508.00 | 1.37 |
| 17 | 601567 | 三星医疗 | 2,052,213.00 | 1.37 |
| 18 | 300002 | 神州泰岳 | 2,024,964.00 | 1.35 |
| 19 | 601019 | 山东出版 | 2,020,257.00 | 1.35 |
| 20 | 600502 | 安徽建工 | 2,020,081.00 | 1.35 |

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 | 625,003,554.41 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 636,609,959.30 |

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

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

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

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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 | - |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 48,037.15 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 48,037.15 |

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

| 份额级别 | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------------|-----------|-----------|---------------|------------|----------------|------------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 (%) | 持有份额 | 占总份额比例 (%) |
| 景顺长城中证 1000 指数增强 A | 4,948 | 12,262.26 | 4,502.12 | 0.01 | 60,669,138.71 | 99.99 |
| 景顺长城中证 1000 指数增强 C | 4,015 | 17,916.62 | 16,697,151.07 | 23.21 | 55,238,076.76 | 76.79 |
| 合计 | 8,963 | 14,795.14 | 16,701,653.19 | 12.59 | 115,907,215.47 | 87.41 |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|--------------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 景顺长城中证 1000 指数增强 A | 486,961.77 | 0.802592 |
| | 景顺长城中证 1000 指数增强 C | 7.00 | 0.000010 |
| | 合计 | 486,968.77 | 0.367222 |

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 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|--------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 景顺长城中证 1000 指数增强 A | 10~50 |
| | 景顺长城中证 1000 指数增强 C | - |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本 | 景顺长城中证 1000 指数增强 A | 10~50 |

| | | |
|-------|--------------------|-------|
| 开放式基金 | 景顺长城中证 1000 指数增强 C | - |
| | 合计 | 10~50 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 景顺长城中证 1000 指数增强 A | 景顺长城中证 1000 指数增强 C |
|--------------------------------|--------------------|--------------------|
| 基金合同生效日（2022 年 4 月 27 日）基金份额总额 | 317,257,520.90 | 264,646,728.20 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 58,382,476.41 | 94,942,758.76 |
| 本报告期基金总申购份额 | 14,257,925.24 | 69,022,503.52 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 11,966,760.82 | 92,030,034.45 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 60,673,640.83 | 71,935,227.83 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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

本基金本报告期未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------------|--------|------------------|------------------|------------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 中信建投证券股份有限公司 | 3 | 1,205,555,975.47 | 95.60 | 622,815.11 | 95.49 | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | 3 | 55,436,990.89 | 4.40 | 29,448.47 | 4.51 | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、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情况稳定；
- 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。

2、本基金本期交易单元未发生变更。

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 (%) |

| | | | | (%) | | |
|--------------|------------|--------|---|-----|---|---|
| 中信建投证券股份有限公司 | 139,213.67 | 100.00 | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

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 | 景顺长城基金管理有限公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年1月10日 |
| 2 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2023年第4季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年1月22日 |
| 3 | 景顺长城中证1000指数增强型证券投资基金2023年第4季度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年1月22日 |
| 4 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增微众银行为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年2月23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 | 2024年3月22日 |
| 6 | 关于警惕假冒景顺长城基金APP开展诈骗活动的声明 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年3月27日 |
| 7 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2023年年度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年3月29日 |
| 8 | 景顺长城中证1000指数增强型证券投资基金2023年年度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年3月29日 |
| 9 | 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 | 2024年4月13日 |
| 10 | 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 | 2024年4月15日 |
| 11 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2024年第1季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年4月22日 |
| 12 | 景顺长城中证1000指数增强型证券投资基金2024年第1季度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年4月22日 |
| 13 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信证券为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年5月21日 |
| 14 | 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 | 2024年5月24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 | 2024年5月31日 |
| 16 | 景顺长城中证1000指数增强型证券 | 中国证监会指定报刊及 | 2024年6月14日 |

| | | | |
|----|---------------------------------|--------------|-----------------|
| | 投资基金基金产品资料概要更新 | 网站 | |
| 17 | 景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 6 月 21 日 |
| 18 | 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 | 2024 年 6 月 29 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|---------------|------|---------------|------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 机构 | 1 | 20240101-20240624 | 44,912,107.89 | 0.00 | 44,912,107.89 | 0.00 | 0.00 |

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：

1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日