景顺长城国证2000指数增强型证券投资基金
2026年第3季度报告

2026年9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：中信证券股份有限公司

报告送出日期：2026年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城国证 2000 指数增强
基金主代码	019013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 5 日
报告期末基金份额总额	49,537,830.26 份
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	1、资产配置策略 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。 2、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，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。 3、债券投资策略 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。 4、股指期货投资策略 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。

	5、国债期货投资策略 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。 6、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。 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。 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。 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。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。	
业绩比较基准	国证 2000 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。	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	景顺长城国证 2000 指数增强 A	景顺长城国证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	019013	019014
报告期末下属分级基金的份额总额	5,566,351.16 份	43,971,479.10 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	景顺长城国证 2000 指数增强 A	景顺长城国证 2000 指数增强 C
1.本期已实现收益	-527,829.25	-4,304,066.27
2.本期利润	-1,491,140.45	-11,259,933.89

3.加权平均基金份额本期利润	-0.2567	-0.2447
4.期末基金资产净值	8,929,470.88	69,668,153.99
5.期末基金份额净值	1.6041	1.5843

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、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

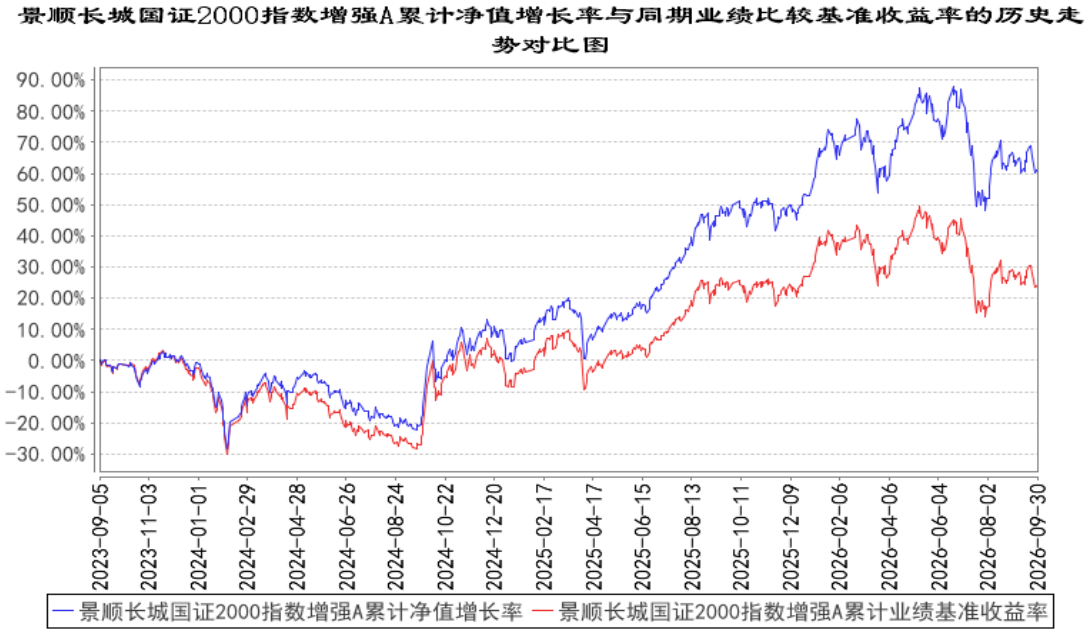
景顺长城国证 2000 指数增强 A

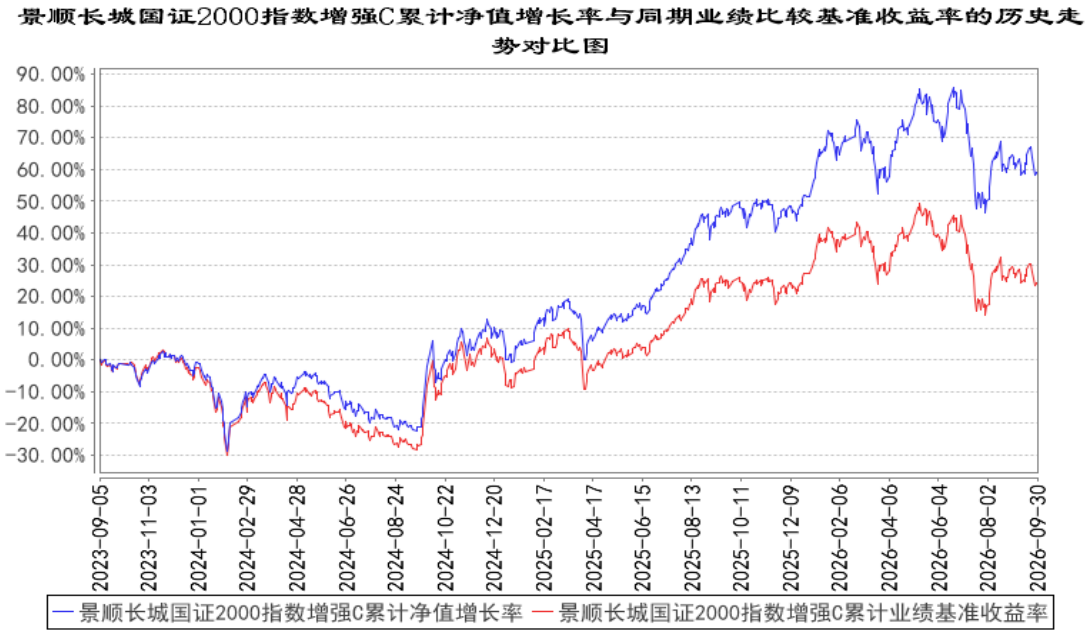
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-13.52%	1.95%	-14.13%	1.98%	0.61%	-0.03%
过去六个月	0.96%	1.78%	-3.44%	1.79%	4.40%	-0.01%
过去一年	7.17%	1.60%	-1.07%	1.60%	8.24%	0.00%
过去三年	62.14%	1.70%	25.09%	1.73%	37.05%	-0.03%
自基金合同生效起至今	60.41%	1.68%	23.56%	1.72%	36.85%	-0.04%

景顺长城国证 2000 指数增强 C

阶段	净值增长率①	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	-13.61%	1.95%	-14.13%	1.98%	0.52%	-0.03%
过去六个月	0.76%	1.78%	-3.44%	1.79%	4.20%	-0.01%
过去一年	6.74%	1.60%	-1.07%	1.60%	7.81%	0.00%
过去三年	60.19%	1.70%	25.09%	1.73%	35.10%	-0.03%
自基金合同生效起至今	58.43%	1.68%	23.56%	1.72%	34.87%	-0.04%

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





注：本基金的投资组合比例为：本基金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）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 2023 年 9 月 5 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2023 年 9 月 5 日	-	16 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 16 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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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、《景顺长城国证 2000 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 公平交易专项说明

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 1 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，国内经济在结构转型中总体平稳运行，新动能对经济增长的支撑作用持续增强，工业品价格延续回升态势，海外货币政策环境出现边际变化。从数据来看，2026 年 7-9 月国内制造业 PMI 依次为 49.2、49.8、50.1，7 月受前期基数较高及部分行业进入传统生产淡季等因素影响有所回落，此后连续两个月回升，9 月重回扩张区间。2026 年 1-8 月规模以上工业增加值累计同比增长 5.3%，其中 8 月高技术制造业增加值同比增长 16.7%，新动能引领作用突出；1-8 月全国规模以上工业企业利润累计同比增长 15.7%，营业收入利润率为 5.66%，同比提高 0.44 个百分点，企业盈利保持较快增长。外需保持较强韧性，1-8 月以人民币计价的出口金额同比增长 14.6%。价格方面，8 月 CPI 同比上涨 0.8%，环比上涨 0.4%，扣除食品和能源价格的核心 CPI 同比上涨 1.0%，物价温和回升；8 月 PPI 同比上涨 3.8%，环比上涨 0.4%，同比涨幅较 7 月扩大 0.3 个百分点。货币金融方面，8 月末 M2 同比增长 7.5%，M1 同比增长 4.1%；三季度央行继续实施适度宽松的货币政策，9 月下旬下调抵押补充贷款利率并增加科技创新和技术改造、支农支小等再贷款额度，8000 亿元新型政策性金融工具亦自 9 月起陆续投放。海外方面，美联储于 9 月将联邦基金利率目标区间上调 25 个基点至 3.75%-4.00%，美元指数走强；9 月末我国外汇储备规模为 34003 亿美元，较 8 月末下降 381 亿美元，已连续六个月保持在 3.4 万亿美元以上，人民币汇率总体保持基本稳定。三季度 A 股市场风格轮动明显加快，前期涨幅较大的科技成长板块出现较大幅度调整，煤炭、石油石化、银行、医药生物等板块表现相对较好。从主要指数来看，三季度上证指数、沪深 300 指数及创业板指分别下跌 6.16%、12.49%、27.80%。

展望未来，作为“十五五”规划开局之年的重要阶段，国内宏观政策有望继续保持积极有为的取向。财政政策方面，8000 亿元新型政策性金融工具加快投放，重点支持新质生产力和“六张网”等重大基础设施建设，叠加存量政策加快落地与增量政策适时推出，有效投资有望得到进一步支撑。货币政策方面，央行明确继续实施适度宽松的货币政策，加大逆周期调节力度，加强货币财政政策协同配合，国内流动性环境总体有利。随着产业结构持续优化以及工业品价格回升，企业盈利状况有望得到进一步改善，内需修复的持续性仍需跟踪观察。外部环境方面，美联储重启加息后海外流动性环境的变化、主要经济体货币政策走向以及国际经贸形势等因素仍需密切关

注。市场层面，三季度市场风格切换较快、板块之间分化明显，个股层面的定价差异有所扩大，这为基于基本面的量化选股模型提供了较大的发挥空间；同时，我们将更加重视对组合行业及风格暴露的控制，在风格快速轮动的环境中力求组合运行的稳健性。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，以人工智能、高端装备、新能源为代表的新质生产力相关产业仍处于加快发展阶段，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值处于长期价值配置区间，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。

本基金是以国证 2000 指数为基准的指数增强基金，国证 2000 指数汇集了中小市值企业，行业分布更加均匀，在市场预期改善以及经济修复的过程中将有更大的弹性。选股层面，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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-13.52%，业绩比较基准收益率为-14.13%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为-13.61%，业绩比较基准收益率为-14.13%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	71,640,281.88	88.00
	其中：股票	71,640,281.88	88.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,100.16	0.01
	其中：债券	10,100.16	0.01
	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	8,435,885.90	10.36
8	其他资产	1,325,711.86	1.63
9	合计	81,411,979.80	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	259,769.90	0.33
B	采矿业	1,500,580.60	1.91
C	制造业	46,193,287.26	58.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,506,861.00	1.92
E	建筑业	528,049.00	0.67
F	批发和零售业	1,473,604.00	1.87
G	交通运输、仓储和邮政业	832,774.32	1.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,936,413.80	7.55
J	金融业	563,524.00	0.72
K	房地产业	663,836.00	0.84
L	租赁和商务服务业	525,132.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	1,236,704.00	1.57
N	水利、环境和公共设施管理业	465,060.00	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	9,368.00	0.01
Q	卫生和社会工作	308,070.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	732,844.00	0.93
S	综合	161,760.00	0.21
	合计	62,897,637.88	80.02

5.2.2 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	53,090.00	0.07
B	采矿业	175,532.00	0.22
C	制造业	5,830,159.00	7.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	185,944.00	0.24
E	建筑业	156,846.00	0.20
F	批发和零售业	312,832.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	8,316.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	712,815.00	0.91
J	金融业	232,499.00	0.30
K	房地产业	244,654.00	0.31
L	租赁和商务服务业	465,927.00	0.59

M	科学研究和技术服务业	67,559.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	57,003.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	146,702.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	92,766.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	8,742,644.00	11.12

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	688630	芯碁微装	1,000	388,680.00	0.49
2	688390	固德威	6,800	376,448.00	0.48
3	002479	富春环保	63,800	368,764.00	0.47
4	002746	仙坛股份	53,000	329,660.00	0.42
5	002833	弘亚数控	15,400	297,682.00	0.38
6	000612	焦作万方	27,800	290,232.00	0.37
7	300233	金城医药	21,100	286,960.00	0.37
8	688559	海目星	5,800	283,040.00	0.36
9	688167	炬光科技	951	269,018.88	0.34
10	002048	宁波华翔	15,000	265,050.00	0.34

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	601828	美凯龙	84,700	188,881.00	0.24
2	002738	中矿资源	3,500	148,750.00	0.19
3	300682	朗新科技	16,700	144,789.00	0.18
4	001389	广合科技	800	141,328.00	0.18
5	600153	建发股份	15,500	136,710.00	0.17

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	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）	10,100.16	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,100.16	0.01

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127117	奥士转债	51	5,100.09	0.01
2	113711	常青转债	50	5,000.07	0.01

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IM2610	IM2610	2	2,919,760.00	-25,000.00	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。

公允价值变动总额合计（元）	-25,000.00
股指期货投资本期收益（元）	-299,477.23
股指期货投资本期公允价值变动（元）	-180,240.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	350,371.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	975,340.66
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,325,711.86

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城国证 2000 指数增强 A	景顺长城国证 2000 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	6,362,448.88	47,239,686.53
报告期期间基金总申购份额	791,675.24	53,515,902.91
减：报告期期间基金总赎回份额	1,587,772.96	56,784,110.34
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	5,566,351.16	43,971,479.10

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；

2、《景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》；

3、《景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金招募说明书》；

4、《景顺长城国证 2000 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。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

9.3 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 10 月 27 日