

景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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）	14
6.1 资产负债表	14
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	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68

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	68
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	69
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	69
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	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.12 投资组合报告附注	69
§ 8 基金份额持有人信息	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
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	71
§ 9 开放式基金份额变动	71
§ 10 重大事件揭示	72
10.1 基金份额持有人大会决议	72
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	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
10.4 基金投资策略的改变	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	72
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	72
10.8 其他重大事件	76
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	77
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	77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§ 12 备查文件目录	78
12.1 备查文件目录	78
12.2 存放地点	79
12.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	景顺长城中证 500 指数增强	
场内简称	无	
基金主代码	006682	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 3 月 25 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	492,608,053.30 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 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	006682	016935
报告期末下属分级基金的份额总额	235,789,990.36 份	256,818,062.94 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	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。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。 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 出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。 4、权证、股指期货投资策略 本基金可投资权证、股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融

	产品。 本基金对权证的分析判断主要从市场环境、时机、权证定价、市场供求、发行人资质、交易冲击等方面综合考量，运用权证定价模型计算权证当前的合理价格。本基金适时选择具有相对优势的权证并制定相应的投资计划。 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。 5、中小企业私募债券的投资策略 对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金将加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率(税后) $\times$ 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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	许俊
	联系电话	0755-82370388	010-66596688
	电子邮箱	investor@igwfm.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008888606	95566
传真		0755-22381339	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		叶才	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	91,284,092.06	83,030,697.25
本期利润	105,178,512.01	94,674,648.76
加权平均基金份 额本期利润	0.3925	0.3407
本期加权平均净 值利润率	22.95%	20.27%
本期基金份额净 值增长率	24.78%	24.53%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	211,810,596.15	224,228,347.53
期末可供分配基 金份额利润	0.8983	0.8731
期末基金资产净 值	452,063,560.43	485,534,908.07
期末基金份额净 值	1.9172	1.8905
3.1.3 累计期末 指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净 值增长率	124.74%	54.95%

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 500 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
过去三个月	22.07%	1.53%	17.61%	1.56%	4.46%	-0.03%
过去六个月	24.78%	1.57%	19.93%	1.58%	4.85%	-0.01%
过去一年	59.10%	1.33%	49.68%	1.35%	9.42%	-0.02%
过去三年	65.57%	1.38%	48.15%	1.41%	17.42%	-0.03%
过去五年	46.26%	1.28%	31.61%	1.30%	14.65%	-0.02%
过去七年	139.57%	1.29%	78.59%	1.29%	60.98%	0.00%
自基金合同生效起至今	124.74%	1.30%	58.35%	1.31%	66.39%	-0.01%

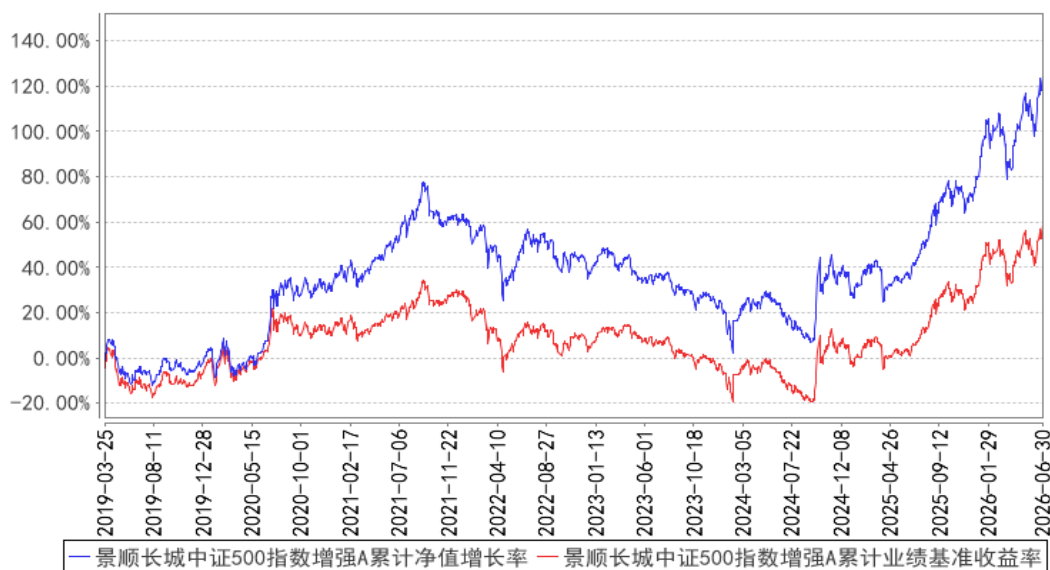
景顺长城中证 500 指数增强 C

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
过去三个月	21.94%	1.53%	17.61%	1.56%	4.33%	-0.03%
过去六个月	24.53%	1.57%	19.93%	1.58%	4.60%	-0.01%
过去一年	58.47%	1.33%	49.68%	1.35%	8.79%	-0.02%
过去三年	63.63%	1.38%	48.15%	1.41%	15.48%	-0.03%
自基金合同生效起至今	54.95%	1.30%	49.05%	1.32%	5.90%	-0.02%

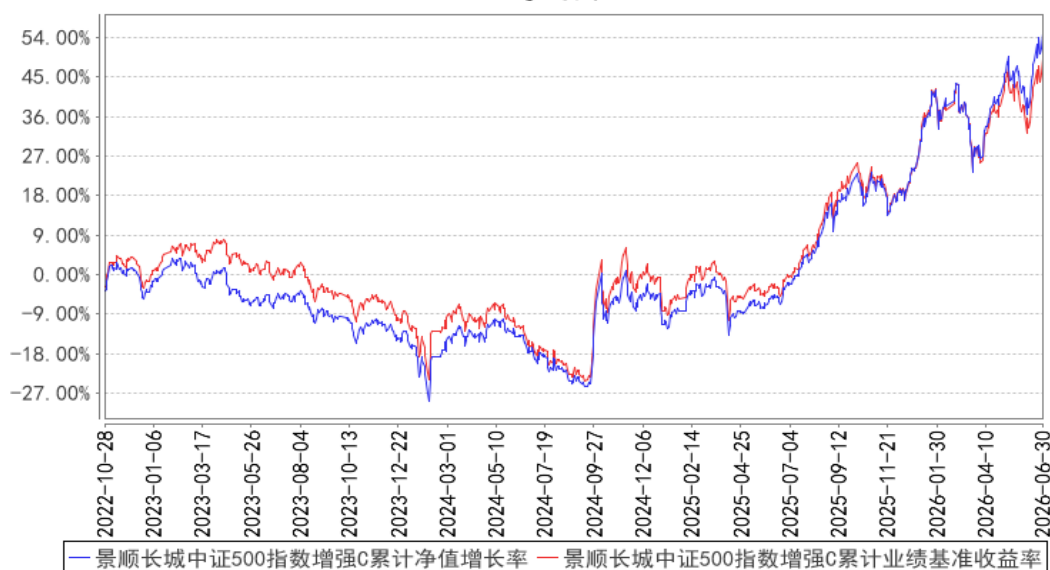
注：本基金于 2022 年 10 月 27 日增设 C 类基金份额，并于 2022 年 10 月 28 日开始对 C 类份额进行估值。

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

景顺长城中证500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500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：基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股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合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2019 年 3 月 25 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。本基金自 2022 年 10 月 27 日起增设 C 类基金份额。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐 喻 军	本基金的基金经理	2019 年 3 月 25 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。
黎 海 威	本基金的基金经理	2019 年 3 月 25 日	-	23 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 23 年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为公司决定且公告的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”及“离任日期”指根据公司决定且

公告的聘任、解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 500 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 10 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内宏观经济延续稳中有进的发展态势，生产端保持较强韧性，价格端出现积极变化，结构性亮点持续涌现。从数据来看，2026 年 4-6 月国内制造业 PMI 依次为 50.3、50.0、50.3，制造业景气水平连续四个月运行在临界点及以上，6 月产需两端同步改善，市场需求有所回暖。上半年国内生产总值同比增长 4.7%，经济运行在合理区间。上半年规模以上工业增加值同比增长 5.4%，其中装备制造业、高技术制造业增加值分别增长 9.3%、13.3%，均明显快于全部规模以上工业，新动能培育成效持续显现。企业效益持续恢复，上半年全国规模以上工业企业利润

同比增长 18.7%，营业收入利润率同比提高 0.59 个百分点，其中高技术制造业、有色金属等行业利润增长较快，引领作用明显。价格端出现积极变化，上半年 CPI 同比上涨 1.0%，其中 6 月 CPI 同比上涨 1.0%，扣除食品和能源价格的核心 CPI 同比上涨 1.0%，物价保持温和上涨；上半年 PPI 同比上涨 1.5%，实现由负转正（一季度为同比下降 0.6%），其中高技术制造业、有色金属等行业价格上涨较为明显，工业品价格改善的积极信号不断增多。货币金融环境保持稳健，6 月末 M2 同比增长 8.0%，M1 同比增长 4.0%，M2 增速继续高于名义经济增速，为经济发展营造了适宜的货币金融环境。6 月末外汇储备 34163 亿美元，连续第三个月维持在 3.4 万亿美元以上，总体保持基本稳定，人民币汇率整体平稳运行。整体来看，上半年国内经济运行在合理区间，工业企业盈利改善、工业品价格回升、新动能快速成长等积极因素不断累积，经济内生动能逐步增强。上半年 A 股市场整体上行，结构分化较为明显，上证综指上涨 3.16%，沪深 300 指数上涨 7.55%，创业板指上涨 35.58%，市场呈现出较为明显的成长风格占优特征。

4.4.2 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 24.78%，业绩比较基准收益率为 19.93%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 24.53%，业绩比较基准收益率为 19.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，宏观政策或将继续围绕扩大内需、促进科技创新、推动产业升级等重点方向持续发力。“十五五”规划开局之年的各项政策部署有望加快落地，“两新”政策（大规模设备更新和消费品以旧换新）持续显效，内需对经济增长的支撑作用有望进一步增强。货币政策保持适度宽松的基调，流动性环境总体有利。工业品价格的回升有望改善企业盈利预期，为权益市场提供基本面支撑。外部环境方面，海外主要经济体货币政策走向、国际经贸形势变化以及地缘不确定性因素仍需密切关注。同时，随着经济动能的持续转换，以人工智能、新能源、高端装备为代表的新质生产力相关产业有望延续较高景气度，权益市场仍具有较多结构性投资机会。个股层面相对充裕的流动性环境、市场层面结构性分化的行情特征，对于量化选股模型而言是相对有利的环境。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 股市场整体估值处于合理区间，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 500 指数为基准的指数增强基金，中证 500 指数汇集了 A 市场的中大市值的个股，行业分布更加均匀。在组合构建层面，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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	71,639,884.66	74,576,971.64
结算备付金		18,200,090.73	13,261,913.12
存出保证金		5,760,682.06	5,087,653.50
交易性金融资产	6.4.7.2	845,789,039.84	821,756,960.45
其中：股票投资		845,602,375.67	821,722,959.93
基金投资		-	-
债券投资		186,664.17	34,000.52
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		148,836.81	2,390,061.41
应收股利		-	-
应收申购款		1,888,117.58	563,603.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		943,426,651.68	917,637,163.33
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,985,626.72	5,795,666.52

应付管理人报酬		793,459.46	959,812.52
应付托管费		132,243.26	159,968.75
应付销售服务费		121,182.36	146,500.16
应付投资顾问费		-	-
应交税费		123,106.54	155,736.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	672,564.84	690,327.73
负债合计		5,828,183.18	7,908,012.66
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	492,608,053.30	595,453,966.39
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	444,990,415.20	314,275,184.28
净资产合计		937,598,468.50	909,729,150.67
负债和净资产总计		943,426,651.68	917,637,163.33

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 492,608,053.30 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.9172 元，基金份额 235,789,990.36 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.8905 元，基金份额 256,818,062.94 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		207,387,860.15	50,534,143.70
1. 利息收入		212,934.06	136,019.46
其中：存款利息收入	6.4.7.13	212,934.06	136,019.46
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）		181,024,441.97	35,098,023.10
其中：股票投资收益	6.4.7.14	167,109,889.10	28,371,862.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	140,956.56	138,625.82
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	8,557,463.31	-334,888.52
股利收益	6.4.7.19	5,216,133.00	6,922,423.18
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	25,546,107.09	14,871,402.45
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	604,377.03	428,698.69
减：二、营业总支出		7,534,699.38	6,408,291.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,536,806.84	5,234,133.79
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	922,801.15	872,355.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	936,142.51	162,395.60
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		38,630.46	2,890.96
8. 其他费用	6.4.7.23	100,318.42	136,515.78
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		199,853,160.77	44,125,851.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		199,853,160.77	44,125,851.91
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		199,853,160.77	44,125,851.91

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产	595,453,966.39	-	314,275,184.28	909,729,150.67

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	595,453,966.39	-	314,275,184.28	909,729,150.67
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-102,845,913.09	-	130,715,230.92	27,869,317.83
(一)、综合收益总额	-	-	199,853,160.77	199,853,160.77
(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)	-102,845,913.09	-	-69,137,929.85	-171,983,842.94
其中：1. 基金申购款	455,480,340.38	-	319,874,927.01	775,355,267.39
2. 基金赎回款	-558,326,253.47	-	-389,012,856.86	-947,339,110.33
(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	492,608,053.30	-	444,990,415.20	937,598,468.50
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	802,386,921.21	-	273,261,972.25	1,075,648,893.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	802,386,921.21	-	273,261,972.25	1,075,648,893.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-351,737,081.65	-	-87,397,493.31	-439,134,574.96
(一)、综合收益总额	-	-	44,125,851.91	44,125,851.91
(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)	-351,737,081.65	-	-131,523,345.22	-483,260,426.87
其中：1. 基金申购款	27,295,497.40	-	9,621,770.55	36,917,267.95
2. 基金赎回款	-379,032,579.05	-	-141,145,115.77	-520,177,694.82
(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	450,649,839.56	-	185,864,478.94	636,514,318.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1897 号文《关于准予景顺长城中证 500 指

数增强型证券投资基金注册的批复》，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 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 2019 年 3 月 25 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 1,507,912,000.78 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 967,567.93 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,508,879,568.71 元，折合 1,508,879,568.71 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金自 2022 年 10 月 27 日起增设 C 类基金份额，原份额转为 A 类基金份额。

本基金的投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。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分股（包含创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。

本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%-95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股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合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2026 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(1) 增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

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

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

（2）企业所得税

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

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

（3）个人所得税

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

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

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

（4）印花税

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

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号《财政部 国家税务总局 证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号《财政部 国家税务总局 证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
活期存款	71,639,884.66
等于：本金	71,633,606.44
加：应计利息	6,278.22
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1个月（含）-3个月	-
存款期限3个月（含）至1年	-
存款期限1年（含）以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	71,639,884.66

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		786,193,758.34	-	845,602,375.67	59,408,617.33
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	185,800.00	4.82	186,664.17	859.35
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	185,800.00	4.82	186,664.17	859.35
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	786,379,558.34	4.82	845,789,039.84	59,409,476.68
----	----------------	------	----------------	---------------

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	40,908,211.11	-	-	-
其中：股指期货投资	40,908,211.11	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	40,908,211.11	-	-	-

注：衍生金融资产项下的国债/股指期货投资期末合同/名义金额为初始合约价值。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2607	IC2607	18.00	32,141,520.00	2,660,048.89
IC2609	IC2609	7.00	12,265,960.00	839,220.00
合计				3,499,268.89
减：可抵销期货暂收款				3,499,268.89
净额				0.00

注：1、衍生金融资产项下的国债/股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债/股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债/股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,755.93
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	584,028.46

其中：交易所市场	584,028.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	672,564.84

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城中证 500 指数增强 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	312,343,285.30	312,343,285.30
本期申购	87,701,329.96	87,701,329.96
本期赎回（以“-”号填列）	-164,254,624.90	-164,254,624.90
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	235,789,990.36	235,789,990.36

景顺长城中证 500 指数增强 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	283,110,681.09	283,110,681.09
本期申购	367,779,010.42	367,779,010.42
本期赎回（以“-”号填列）	-394,071,628.57	-394,071,628.57
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	256,818,062.94	256,818,062.94

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 500 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	177,106,189.15	-9,530,137.71	167,576,051.44
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	177,106,189.15	-9,530,137.71	167,576,051.44
本期利润	91,284,092.06	13,894,419.95	105,178,512.01
本期基金份额交易产生的变动数	-56,579,685.06	98,691.68	-56,480,993.38
其中：基金申购款	62,504,263.83	-1,365,127.81	61,139,136.02
基金赎回款	-119,083,948.89	1,463,819.49	-117,620,129.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	211,810,596.15	4,462,973.92	216,273,570.07

景顺长城中证 500 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	155,548,783.20	-8,849,650.36	146,699,132.84
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	155,548,783.20	-8,849,650.36	146,699,132.84
本期利润	83,030,697.25	11,643,951.51	94,674,648.76
本期基金份额交易产生的变动数	-14,351,132.92	1,694,196.45	-12,656,936.47
其中：基金申购款	263,952,458.27	-5,216,667.28	258,735,790.99
基金赎回款	-278,303,591.19	6,910,863.73	-271,392,727.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	224,228,347.53	4,488,497.60	228,716,845.13

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	144,107.90
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	46,108.75
其他	22,717.41
合计	212,934.06

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	167,109,889.10
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	167,109,889.10

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,195,007,252.88
减：卖出股票成本总额	3,024,688,280.93
减：交易费用	3,209,082.85
买卖股票差价收入	167,109,889.10

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	13.51
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	140,943.05
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	140,956.56

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	282,263.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	141,300.00
减：应计利息总额	9.28
减：交易费用	11.41
买卖债券差价收入	140,943.05

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	8,557,463.31

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,216,133.00
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	5,216,133.00

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	23,397,319.60
股票投资	23,396,460.25
债券投资	859.35
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	2,213,251.11
权证投资	-
期货投资	2,213,251.11

3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	64,463.62
合计	25,546,107.09

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	567,577.59
基金转换费收入	36,799.44
合计	604,377.03

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行划款手续费	13,465.00
存托服务费	72.97
合计	100,318.42

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金 额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
长城证券	-	-	408,136,181.97	6.19

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
长城证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
长城证券	79,586.59	6.19	79,586.59	14.67

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,536,806.84	5,234,133.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,428,843.53	1,503,235.30
应支付基金管理人的净管理费	4,107,963.31	3,730,898.49

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月

月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	922,801.15	872,355.66

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	—	568,360.59	568,360.59
中国银行	—	—	—
长城证券	—	—	—
合计	—	568,360.59	568,360.59
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	—	83.50	83.50
中国银行	—	—	—
长城证券	—	—	—
合计	—	83.50	83.50

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均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	71,639,884.66	144,107.90	35,650,364.36	94,244.78

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券	成功认购	受限期	流通受限	认购价格	期末估值单价	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称	日		类型			位： 股)			
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	4,035	40,834.20	111,890.55	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷	2026 年 3	6 个月	新股流通	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-

	新材	月 24 日		受限						
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-
688781	视涯	2026 年 3 月	6 个月	新股流通	22.68	47.61	217	4,921.56	10,331.37	-

	科技	月 18 日		受限						
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,506	29,638.08	213,083.94	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	970	97,000.00	97,001.28	-
113703	翔 26 转债	2026 年 6 月 9 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	30	3,000.00	3,000.30	-
113704	春风转债	2026 年 6 月 11 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	570	57,000.00	57,002.62	-
118071	华	2026	1 个月	新债	100.00	100.00	240	24,000.00	24,000.42	-

	峰转债	年 6 月 24 日	内（含）	未上市						
127114	宜化转债	2026 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	33	3,300.00	3,300.07	-

注：以上限售证券的实际流通日期以上市公司的公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	200	124,043.64	166,400.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和

及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.02%（上年度末：0.00%）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

持续的监测和分析。

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	71,639,884.66	-	-	-	-	-	71,639,884.66
结算备付金	18,200,090.73	-	-	-	-	-	18,200,090.73
存出保证金	431,784.46	-	-	-	-	5,328,897.60	5,760,682.06
交易性金融资产	-	-	-	-	186,664.17	845,602,375.67	845,789,039.84
应收申购款	-	-	-	-	-	1,888,117.58	1,888,117.58
应收清算款	-	-	-	-	-	148,836.81	148,836.81
资产总计	90,271,759.85	-	-	-	186,664.17	852,968,227.66	943,426,651.68
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,985,626.72	3,985,626.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	793,459.46	793,459.46
应付托管费	-	-	-	-	-	132,243.26	132,243.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-	121,182.36	121,182.36
应交税费	-	-	-	-	-	123,106.54	123,106.54
其他负债	-	-	-	-	-	672,564.84	672,564.84
负债总计	-	-	-	-	-	5,828,183.18	5,828,183.18
利率敏感度缺口	90,271,759.85	-	-	-	186,664.17	-	-
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	74,576,971.64	-	-	-	-	-	74,576,971.64
结算备付金	13,261,913.12	-	-	-	-	-	13,261,913.12

存出保证金	127,698.30	-	-	-	-	4,959,955.20	5,087,653.50
交易性金融资产	-	-	-	-	34,000.52	821,722,959.93	821,756,960.45
应收申购款	-	-	-	-	-	563,603.21	563,603.21
应收清算款	-	-	-	-	-	2,390,061.41	2,390,061.41
资产总计	87,966,583.06	-	-	-	34,000.52	829,636,579.75	917,637,163.33
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,795,666.52	5,795,666.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	959,812.52	959,812.52
应付托管费	-	-	-	-	-	159,968.75	159,968.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	146,500.16	146,500.16
应交税费	-	-	-	-	-	155,736.98	155,736.98
其他负债	-	-	-	-	-	690,327.73	690,327.73
负债总计	-	-	-	-	-	7,908,012.66	7,908,012.66
利率敏感度缺口	87,966,583.06	-	-	-	34,000.52	-	-

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 0.02%（上年度末：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	845,602,375.67	90.19	821,722,959.93	90.33
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	845,602,375.67	90.19	821,722,959.93	90.33

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注：6.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	48,103,007.16	49,972,548.70
	沪深 300 指数下降 5%	-48,103,007.16	-49,972,548.70

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	844,277,084.33	820,118,900.17
第二层次	350,704.69	979,720.52
第三层次	1,161,250.82	658,339.76
合计	845,789,039.84	821,756,960.45

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	845,602,375.67	89.63
	其中：股票	845,602,375.67	89.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	186,664.17	0.02
	其中：债券	186,664.17	0.02
	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	89,839,975.39	9.52
8	其他各项资产	7,797,636.45	0.83
9	合计	943,426,651.68	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	1,605,085.00	0.17
B	采矿业	20,861,847.58	2.23
C	制造业	550,979,689.13	58.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,479,481.00	1.33
E	建筑业	4,813,618.00	0.51
F	批发和零售业	14,594,716.20	1.56
G	交通运输、仓储和邮政业	8,682,021.00	0.93
H	住宿和餐饮业	107,940.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,412,623.33	4.20
J	金融业	36,649,084.32	3.91
K	房地产业	2,677,132.80	0.29
L	租赁和商务服务业	4,864,552.00	0.52
M	科学研究和技术服务业	11,308,334.00	1.21
N	水利、环境和公共设施管理业	9,718,375.60	1.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	235,784.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	477,298.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	719,467,581.96	76.74

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	340,186.00	0.04

B	采矿业	3,466,100.96	0.37
C	制造业	89,016,981.75	9.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,604,851.00	0.17
E	建筑业	1,268,860.00	0.14
F	批发和零售业	327,758.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,421,252.00	0.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,727,586.40	1.25
J	金融业	5,108,026.00	0.54
K	房地产业	2,637,170.00	0.28
L	租赁和商务服务业	2,448,507.60	0.26
M	科学研究和技术服务业	4,312,199.00	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	48,000.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	652,650.00	0.07
Q	卫生和社会工作	39,585.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,491,574.00	0.16
S	综合	223,506.00	0.02
	合计	126,134,793.71	13.45

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	688498	源杰科技	7,900	14,899,400.00	1.59
2	300223	北京君正	49,400	12,295,660.00	1.31
3	300857	协创数据	29,980	10,190,202.00	1.09
4	300475	香农芯创	33,500	10,050,000.00	1.07
5	300604	长川科技	27,500	9,389,050.00	1.00
6	002281	光迅科技	36,500	9,378,310.00	1.00
7	688120	华海清科	28,313	9,121,882.34	0.97

8	600105	永鼎股份	127,500	8,603,700.00	0.92
9	002008	大族激光	56,700	8,511,237.00	0.91
10	688347	华虹宏力	24,952	8,391,357.60	0.89
11	002436	兴森科技	159,600	8,131,620.00	0.87
12	002851	麦格米特	48,100	8,041,358.00	0.86
13	300373	扬杰科技	50,847	7,994,673.81	0.85
14	300567	精测电子	24,100	7,654,160.00	0.82
15	300346	南大光电	80,900	7,495,385.00	0.80
16	688002	睿创微纳	46,908	7,256,198.52	0.77
17	300395	菲利华	53,000	7,087,690.00	0.76
18	688578	艾力斯	62,771	6,854,593.20	0.73
19	002185	华天科技	302,500	6,748,775.00	0.72
20	002138	顺络电子	91,550	6,692,305.00	0.71
21	300666	江丰电子	17,400	6,413,640.00	0.68
22	002266	浙富控股	1,219,300	6,169,658.00	0.66
23	605358	立昂微	79,300	6,153,680.00	0.66
24	600497	驰宏锌锗	497,800	6,028,358.00	0.64
25	688361	中科飞测	13,889	5,972,270.00	0.64
26	002409	雅克科技	25,900	5,814,550.00	0.62
27	688629	华丰科技	30,900	5,794,059.00	0.62
28	002738	中矿资源	97,200	5,733,828.00	0.61
29	600498	烽火通信	74,800	5,505,280.00	0.59
30	301536	星辰科技	41,800	5,380,078.00	0.57
31	601233	桐昆股份	240,300	5,202,495.00	0.55
32	688777	中控技术	42,296	4,969,780.00	0.53
33	000783	长江证券	497,100	4,846,725.00	0.52
34	002273	水晶光电	133,000	4,718,840.00	0.50
35	300759	康龙化成	161,800	4,680,874.00	0.50
36	002517	恺英网络	286,700	4,658,875.00	0.50
37	600166	福田汽车	1,600,200	4,656,582.00	0.50
38	300037	新宙邦	48,200	4,475,370.00	0.48
39	000021	深科技	67,900	4,363,933.00	0.47
40	300054	鼎龙股份	40,888	4,332,901.36	0.46
41	601108	财通证券	496,360	4,293,514.00	0.46
42	000060	中金岭南	549,500	4,159,715.00	0.44
43	600392	盛和资源	138,700	4,129,099.00	0.44
44	688469	芯联集成	389,027	4,127,576.47	0.44
45	601156	东航物流	253,700	4,089,644.00	0.44
46	300001	特锐德	107,200	4,055,376.00	0.43
47	301526	国际复材	84,800	3,957,616.00	0.42
48	300136	信维通信	32,800	3,911,400.00	0.42
49	002414	高德红外	292,920	3,884,119.20	0.41
50	300073	当升科技	80,800	3,881,632.00	0.41

51	600369	西南证券	952,400	3,828,648.00	0.41
52	600988	赤峰黄金	141,304	3,719,121.28	0.40
53	301377	鼎泰高科	6,700	3,691,030.00	0.39
54	603225	新凤鸣	187,700	3,688,305.00	0.39
55	002126	银轮股份	73,300	3,650,340.00	0.39
56	300458	全志科技	91,340	3,604,276.40	0.38
57	600601	方正科技	257,800	3,567,952.00	0.38
58	600885	宏发股份	102,236	3,526,119.64	0.38
59	601869	长飞光纤	6,400	3,493,760.00	0.37
60	688017	绿的谐波	8,204	3,428,123.44	0.37
61	000519	中兵红箭	158,300	3,335,381.00	0.36
62	688266	泽璟制药	28,400	3,313,144.00	0.35
63	603650	彤程新材	33,300	3,262,734.00	0.35
64	688037	芯源微	7,400	3,248,970.00	0.35
65	002056	横店东磁	106,400	3,243,072.00	0.35
66	601666	平煤股份	446,700	3,193,905.00	0.34
67	601699	潞安环能	218,700	3,123,036.00	0.33
68	300919	中伟新材	71,300	3,119,375.00	0.33
69	600109	国金证券	352,700	3,096,706.00	0.33
70	600535	天士力	231,000	3,056,130.00	0.33
71	688052	纳芯微	10,600	3,056,086.00	0.33
72	301611	珂玛科技	16,800	3,025,176.00	0.32
73	688301	奕瑞科技	24,376	3,022,624.00	0.32
74	603858	步长制药	205,630	3,002,198.00	0.32
75	688411	海博思创	9,900	2,882,880.00	0.31
76	603737	三棵树	119,616	2,882,745.60	0.31
77	002926	华西证券	351,200	2,869,304.00	0.31
78	002340	格林美	431,700	2,853,537.00	0.30
79	300623	捷捷微电	63,000	2,834,370.00	0.30
80	001696	宗申动力	134,500	2,798,945.00	0.30
81	600970	中材国际	391,400	2,790,682.00	0.30
82	300757	罗博特科	4,500	2,785,500.00	0.30
83	600378	昊华科技	36,700	2,766,446.00	0.30
84	300012	华测检测	198,500	2,751,210.00	0.29
85	300432	富临精工	136,500	2,742,285.00	0.29
86	601997	贵阳银行	523,300	2,684,529.00	0.29
87	002271	东方雨虹	225,400	2,675,498.00	0.29
88	603256	宏和科技	10,000	2,653,300.00	0.28
89	002064	华峰化学	274,300	2,603,107.00	0.28
90	688248	南网科技	36,900	2,552,742.00	0.27
91	002821	凯莱英	15,600	2,527,200.00	0.27
92	600352	浙江龙盛	208,000	2,518,880.00	0.27
93	688385	复旦微电	35,300	2,516,537.00	0.27

94	301200	大族数控	6,800	2,452,420.00	0.26
95	600909	华安证券	220,500	2,449,755.00	0.26
96	600801	华新建材	156,100	2,435,160.00	0.26
97	300620	光库科技	6,300	2,382,660.00	0.25
98	000629	钒钛股份	688,500	2,299,590.00	0.25
99	603568	伟明环保	145,720	2,241,173.60	0.24
100	002472	双环传动	53,900	2,237,389.00	0.24
101	603379	三美股份	29,400	2,231,166.00	0.24
102	000921	海信家电	81,200	2,218,384.00	0.24
103	600038	中直股份	87,000	2,200,230.00	0.23
104	000598	兴蓉环境	342,000	2,195,640.00	0.23
105	000983	山西焦煤	377,300	2,188,340.00	0.23
106	003031	中瓷电子	12,100	2,181,630.00	0.23
107	000415	渤海租赁	534,400	2,175,008.00	0.23
108	601555	东吴证券	273,294	2,164,488.48	0.23
109	600177	雅戈尔	285,913	2,152,924.89	0.23
110	000034	神州数码	77,360	2,146,740.00	0.23
111	600298	安琪酵母	58,600	2,121,320.00	0.23
112	300390	天华新能	22,400	2,094,624.00	0.22
113	002203	海亮股份	91,152	2,082,823.20	0.22
114	000513	丽珠集团	71,300	2,059,857.00	0.22
115	002500	山西证券	399,000	2,058,840.00	0.22
116	002402	和而泰	79,700	2,058,651.00	0.22
117	600862	中航高科	113,600	2,048,208.00	0.22
118	002131	利欧股份	428,300	2,034,425.00	0.22
119	688702	盛科通信	5,200	2,027,948.00	0.22
120	301358	湖南裕能	26,700	2,025,729.00	0.22
121	688778	厦钨新能	37,209	2,024,169.60	0.22
122	000800	一汽解放	339,800	2,021,810.00	0.22
123	002841	视源股份	58,400	2,016,552.00	0.22
124	688676	金盘科技	23,800	2,014,432.00	0.21
125	000739	普洛药业	120,600	2,009,196.00	0.21
126	688172	燕东微	23,900	1,999,474.00	0.21
127	300285	国瓷材料	19,000	1,960,420.00	0.21
128	688568	中科星图	46,900	1,944,943.00	0.21
129	688200	华峰测控	3,700	1,942,870.00	0.21
130	688322	奥比中光	14,800	1,932,140.00	0.21
131	600004	白云机场	265,950	1,930,797.00	0.21
132	300207	欣旺达	101,200	1,921,788.00	0.20
133	001389	广合科技	8,100	1,921,725.00	0.20
134	600863	华能蒙电	407,000	1,912,900.00	0.20
135	002410	广联达	233,840	1,908,134.40	0.20
136	603156	养元饮品	38,700	1,899,009.00	0.20

137	002487	大金重工	32,400	1,878,228.00	0.20
138	600483	福能股份	184,100	1,875,979.00	0.20
139	000733	振华科技	33,100	1,874,784.00	0.20
140	002065	东华软件	260,900	1,862,826.00	0.20
141	603806	福斯特	110,200	1,850,258.00	0.20
142	688582	芯动联科	28,000	1,820,000.00	0.19
143	300339	润和软件	47,200	1,817,672.00	0.19
144	600316	洪都航空	63,500	1,774,190.00	0.19
145	000959	首钢股份	503,600	1,767,636.00	0.19
146	688099	晶晨股份	17,143	1,764,014.70	0.19
147	603345	安井食品	21,900	1,756,161.00	0.19
148	600008	首创环保	643,500	1,750,320.00	0.19
149	000932	华菱钢铁	484,900	1,682,603.00	0.18
150	300724	捷佳伟创	23,600	1,666,160.00	0.18
151	688213	思特威	15,429	1,651,983.03	0.18
152	688234	天岳先进	9,500	1,648,345.00	0.18
153	000050	深天马 A	164,200	1,627,222.00	0.17
154	600808	马钢股份	642,100	1,605,250.00	0.17
155	601139	深圳燃气	279,000	1,579,140.00	0.17
156	600060	海信视像	56,200	1,566,294.00	0.17
157	600141	兴发集团	33,200	1,559,404.00	0.17
158	603833	欧派家居	51,100	1,538,621.00	0.16
159	603077	和邦生物	663,100	1,538,392.00	0.16
160	002429	兆驰股份	147,600	1,533,564.00	0.16
161	600711	盛屯矿业	139,700	1,532,509.00	0.16
162	605589	圣泉集团	24,100	1,532,037.00	0.16
163	000703	恒逸石化	112,700	1,529,339.00	0.16
164	300570	太辰光	6,100	1,504,931.00	0.16
165	300142	沃森生物	115,400	1,499,046.00	0.16
166	002299	圣农发展	98,400	1,491,744.00	0.16
167	603129	春风动力	5,800	1,483,640.00	0.16
168	600685	中船防务	58,200	1,480,608.00	0.16
169	600282	南钢股份	322,000	1,477,980.00	0.16
170	603816	顾家家居	66,000	1,475,760.00	0.16
171	688599	天合光能	104,400	1,474,128.00	0.16
172	601665	齐鲁银行	252,300	1,455,771.00	0.16
173	688180	君实生物	43,021	1,454,970.22	0.16
174	600688	上海石化	495,300	1,451,229.00	0.15
175	688692	达梦数据	5,800	1,416,882.00	0.15
176	603308	应流股份	23,400	1,413,360.00	0.15
177	300953	震裕科技	10,540	1,409,198.00	0.15
178	601128	常熟银行	237,137	1,380,137.34	0.15
179	000528	柳 工	182,700	1,379,385.00	0.15

180	600595	中孚实业	245,200	1,378,024.00	0.15
181	601608	中信重工	286,100	1,364,697.00	0.15
182	002152	广电运通	144,500	1,355,410.00	0.14
183	688019	安集科技	3,970	1,347,656.20	0.14
184	300676	华大基因	37,700	1,321,762.00	0.14
185	600292	电投水电	108,600	1,307,544.00	0.14
186	601106	中国一重	390,000	1,287,000.00	0.14
187	601865	福莱特	120,300	1,264,353.00	0.13
188	300002	神州泰岳	160,600	1,254,286.00	0.13
189	600968	海油发展	373,700	1,244,421.00	0.13
190	600499	科达制造	90,100	1,243,380.00	0.13
191	603338	浙江鼎力	28,900	1,228,250.00	0.13
192	002465	海格通信	96,000	1,225,920.00	0.13
193	300115	长盈精密	43,800	1,223,772.00	0.13
194	688617	惠泰医疗	6,730	1,221,898.80	0.13
195	002407	多氟多	24,300	1,220,589.00	0.13
196	688220	翱捷科技	9,800	1,218,336.00	0.13
197	688561	奇安信	50,600	1,213,388.00	0.13
198	603486	科沃斯	23,600	1,197,700.00	0.13
199	000951	中国重汽	61,120	1,192,451.20	0.13
200	600906	财达证券	157,600	1,175,696.00	0.13
201	000729	燕京啤酒	115,400	1,169,002.00	0.12
202	600816	建元信托	477,300	1,164,612.00	0.12
203	600637	东方明珠	140,000	1,163,400.00	0.12
204	688235	百济神州	4,500	1,145,745.00	0.12
205	688313	仕佳光子	6,200	1,144,830.00	0.12
206	002153	石基信息	157,400	1,138,002.00	0.12
207	600871	石化油服	556,000	1,128,680.00	0.12
208	002812	恩捷股份	16,700	1,117,397.00	0.12
209	600380	健康元	118,300	1,114,386.00	0.12
210	601717	中创智领	79,300	1,103,063.00	0.12
211	000878	云南铜业	69,300	1,100,484.00	0.12
212	601958	金钼股份	38,700	1,087,857.00	0.12
213	603699	纽威股份	21,300	1,071,390.00	0.11
214	300487	蓝晓科技	18,200	1,071,070.00	0.11
215	002850	科达利	5,600	1,060,080.00	0.11
216	000039	中集集团	129,700	1,051,867.00	0.11
217	000027	深圳能源	165,800	1,027,960.00	0.11
218	002683	广东宏大	34,800	1,019,292.00	0.11
219	300748	金力永磁	33,000	1,018,050.00	0.11
220	002624	完美世界	81,900	1,017,198.00	0.11
221	601155	新城控股	99,000	1,015,740.00	0.11
222	601615	明阳智能	86,100	996,177.00	0.11

223	002461	珠江啤酒	131,520	995,606.40	0.11
224	601399	国机重装	283,100	990,850.00	0.11
225	600927	永安期货	77,900	969,855.00	0.10
226	300677	英科医疗	24,700	967,499.00	0.10
227	002195	岩山科技	145,900	954,186.00	0.10
228	600095	湘财股份	125,200	942,756.00	0.10
229	002603	以岭药业	62,200	933,000.00	0.10
230	001286	陕西能源	91,700	929,838.00	0.10
231	600820	隧道股份	178,300	928,943.00	0.10
232	601118	海南橡胶	187,100	920,532.00	0.10
233	601598	中国外运	184,700	916,112.00	0.10
234	688615	合合信息	8,040	909,324.00	0.10
235	300454	深信服	9,100	875,420.00	0.09
236	000893	亚钾国际	21,300	870,957.00	0.09
237	603298	杭叉集团	36,500	870,890.00	0.09
238	601000	唐山港	205,800	854,070.00	0.09
239	601567	三星电气	55,000	821,700.00	0.09
240	688027	国盾量子	1,600	806,416.00	0.09
241	600329	达仁堂	21,500	800,230.00	0.09
242	688169	石头科技	8,200	778,754.00	0.08
243	002261	拓维信息	27,200	761,872.00	0.08
244	600208	衢州发展	263,800	746,554.00	0.08
245	600566	济川药业	33,200	736,708.00	0.08
246	300474	景嘉微	11,900	719,712.00	0.08
247	000429	粤高速 A	52,500	716,625.00	0.08
248	600516	方大炭素	115,658	713,609.86	0.08
249	603175	超颖电子	8,000	712,720.00	0.08
250	002444	巨星科技	22,400	696,640.00	0.07
251	300957	贝泰妮	22,100	696,371.00	0.07
252	601611	中国核建	61,700	687,955.00	0.07
253	601179	中国西电	45,700	681,844.00	0.07
254	603233	大参林	44,600	670,338.00	0.07
255	603659	璞泰来	22,800	659,604.00	0.07
256	002756	永兴材料	11,500	651,360.00	0.07
257	600985	淮北矿业	45,300	636,465.00	0.07
258	000967	盈峰环境	60,300	634,959.00	0.07
259	002318	久立特材	26,500	633,350.00	0.07
260	600546	山煤国际	57,300	626,289.00	0.07
261	002078	太阳纸业	49,100	613,259.00	0.07
262	300972	万辰集团	3,500	606,935.00	0.06
263	000683	博源化工	98,300	566,208.00	0.06
264	688065	凯赛生物	11,524	551,423.40	0.06
265	688018	乐鑫科技	4,260	544,939.20	0.06

266	603658	安图生物	18,300	531,066.00	0.06
267	000009	中国宝安	83,500	520,205.00	0.06
268	600704	物产中大	108,460	511,931.20	0.05
269	300751	迈为股份	1,800	508,428.00	0.05
270	688188	柏楚电子	4,760	507,892.00	0.05
271	002025	航天电器	6,300	480,186.00	0.05
272	600131	国网信通	32,300	471,580.00	0.05
273	600098	广州发展	79,600	470,436.00	0.05
274	002155	湖南黄金	19,690	470,000.30	0.05
275	000623	吉林敖东	26,000	460,980.00	0.05
276	600143	金发科技	29,500	455,775.00	0.05
277	688166	博瑞医药	12,600	441,126.00	0.05
278	600848	上海临港	58,520	438,314.80	0.05
279	600132	重庆啤酒	10,400	429,520.00	0.05
280	603766	隆鑫通用	35,400	422,322.00	0.05
281	000423	东阿阿胶	9,300	421,848.00	0.04
282	600171	上海贝岭	13,100	418,414.00	0.04
283	300496	中科创达	6,700	413,993.00	0.04
284	600153	建发股份	51,900	411,567.00	0.04
285	600339	中油工程	132,700	407,389.00	0.04
286	600170	上海建工	182,900	406,038.00	0.04
287	002157	正邦科技	143,700	403,797.00	0.04
288	600100	同方股份	57,600	394,560.00	0.04
289	600998	九州通	80,400	377,076.00	0.04
290	688343	云天励飞	4,600	375,636.00	0.04
291	600642	申能股份	40,200	350,946.00	0.04
292	002244	滨江集团	45,100	342,760.00	0.04
293	688387	信科移动	17,200	341,248.00	0.04
294	603087	甘李药业	5,500	312,180.00	0.03
295	600764	中国海防	17,900	311,997.00	0.03
296	000738	航发控制	17,000	310,930.00	0.03
297	600563	法拉电子	1,600	305,280.00	0.03
298	000960	锡业股份	7,100	303,099.00	0.03
299	000709	河钢股份	156,100	302,834.00	0.03
300	603000	人民网	20,400	301,716.00	0.03
301	600598	北大荒	25,900	280,756.00	0.03
302	603920	世运电路	5,800	278,632.00	0.03
303	000831	中国稀土	5,000	277,450.00	0.03
304	002130	沃尔核材	14,300	271,128.00	0.03
305	600879	航天电子	12,300	261,867.00	0.03
306	601098	中南传媒	26,600	261,744.00	0.03
307	000750	国海证券	66,900	246,192.00	0.03
308	600901	江苏金租	42,584	244,858.00	0.03

309	300058	蓝色光标	17,700	243,552.00	0.03
310	000883	湖北能源	55,400	239,328.00	0.03
311	600763	通策医疗	6,900	233,772.00	0.02
312	600562	国睿科技	10,600	224,932.00	0.02
313	600295	鄂尔多斯	20,800	222,976.00	0.02
314	600486	扬农化工	3,800	192,660.00	0.02
315	689009	九号公司	4,902	187,011.30	0.02
316	600299	安迪苏	23,100	181,335.00	0.02
317	603606	东方电缆	4,120	171,021.20	0.02
318	688563	航材股份	3,203	164,089.69	0.02
319	601966	玲珑轮胎	16,100	164,059.00	0.02
320	603979	金诚信	2,600	153,478.00	0.02
321	603444	吉比特	400	143,368.00	0.02
322	600511	国药股份	5,300	138,012.00	0.01
323	600663	陆家嘴	21,300	133,764.00	0.01
324	603688	石英股份	1,500	123,915.00	0.01
325	300017	网宿科技	9,300	120,993.00	0.01
326	000997	新大陆	7,200	117,360.00	0.01
327	688281	华秦科技	2,300	115,529.00	0.01
328	600583	海油工程	22,100	111,163.00	0.01
329	600754	锦江酒店	6,000	107,940.00	0.01
330	603290	斯达半导	700	107,058.00	0.01
331	001203	大中矿业	3,200	95,840.00	0.01
332	603786	科博达	2,300	94,093.00	0.01
333	300699	光威复材	3,200	91,680.00	0.01
334	300763	锦浪科技	1,000	90,350.00	0.01
335	600312	平高电气	5,100	90,066.00	0.01
336	600398	海澜之家	17,200	89,956.00	0.01
337	002739	儒意电影	9,200	88,320.00	0.01
338	000830	鲁西化工	7,300	87,600.00	0.01
339	600977	中国电影	6,700	86,564.00	0.01
340	002120	韵达股份	13,400	85,224.00	0.01
341	688608	恒玄科技	500	83,595.00	0.01
342	688375	国博电子	800	83,440.00	0.01
343	603179	新泉股份	1,620	80,433.00	0.01
344	002432	九安医疗	1,100	77,748.00	0.01
345	003022	联泓新科	3,000	77,700.00	0.01
346	000062	深圳华强	2,300	73,186.00	0.01
347	000987	越秀资本	9,325	72,921.50	0.01
348	000737	北方铜业	5,300	70,066.00	0.01
349	000155	川能动力	5,800	69,484.00	0.01
350	002223	鱼跃医疗	2,701	69,307.66	0.01
351	688349	三一重能	4,528	68,735.04	0.01

352	601112	振石股份	3,775	68,322.25	0.01
353	300735	光弘科技	3,000	68,220.00	0.01
354	600256	广汇能源	13,400	66,196.00	0.01
355	002252	上海莱士	14,800	64,232.00	0.01
356	002265	建设工业	3,400	59,160.00	0.01
357	600377	宁沪高速	5,000	57,850.00	0.01
358	000559	万向钱潮	4,400	56,892.00	0.01
359	000539	粤电力 A	8,300	56,523.00	0.01
360	000825	太钢不锈	16,300	55,583.00	0.01
361	603728	鸣志电器	900	54,828.00	0.01
362	688772	珠海冠宇	2,728	53,550.64	0.01
363	601099	太平洋	14,500	48,865.00	0.01
364	300627	华测导航	1,680	47,712.00	0.01
365	300888	稳健医疗	1,600	44,784.00	0.00
366	002085	万丰奥威	4,000	44,360.00	0.00
367	002673	西部证券	6,400	41,536.00	0.00
368	688187	时代电气	600	41,196.00	0.00
369	600517	国网英大	8,700	40,716.00	0.00
370	300144	宋城演艺	7,000	40,670.00	0.00
371	002984	森麒麟	2,600	33,982.00	0.00
372	688819	天能股份	1,500	33,300.00	0.00
373	600873	梅花生物	4,500	33,075.00	0.00
374	300024	机器人	1,700	32,861.00	0.00
375	600536	中国软件	1,100	30,932.00	0.00
376	300679	电连技术	500	29,995.00	0.00
377	600737	中粮糖业	2,400	29,592.00	0.00
378	000786	北新建材	1,600	28,944.00	0.00
379	002312	川发龙蟒	3,000	27,510.00	0.00
380	000661	长春高新	400	26,640.00	0.00
381	601001	晋控煤业	1,500	26,085.00	0.00
382	688331	荣昌生物	200	26,052.00	0.00
383	688122	西部超导	400	25,124.00	0.00
384	002430	杭氧股份	800	24,768.00	0.00
385	002945	华林证券	1,800	24,174.00	0.00
386	603885	吉祥航空	2,200	22,638.00	0.00
387	600348	华阳股份	2,600	19,890.00	0.00
388	688318	财富趋势	200	14,262.00	0.00
389	002831	裕同科技	400	14,224.00	0.00
390	601991	大唐发电	1,900	13,452.00	0.00
391	600390	五矿资本	2,800	12,768.00	0.00
392	301606	绿联科技	200	12,204.00	0.00
393	601808	中海油服	1,100	11,891.00	0.00
394	600655	豫园股份	2,800	11,508.00	0.00

395	600062	华润双鹤	700	11,228.00	0.00
396	000887	中鼎股份	600	10,734.00	0.00
397	688708	佳驰科技	200	10,160.00	0.00
398	600126	杭钢股份	1,500	9,195.00	0.00
399	601866	中远海发	4,100	9,061.00	0.00
400	603939	益丰药房	500	8,990.00	0.00
401	002966	苏州银行	1,100	7,656.00	0.00
402	600021	上海电力	500	7,535.00	0.00
403	000728	国元证券	700	5,243.00	0.00
404	600765	中航重机	300	3,876.00	0.00
405	300383	光环新网	300	3,732.00	0.00
406	601216	君正集团	800	3,568.00	0.00
407	002568	百润股份	200	3,384.00	0.00
408	601577	长沙银行	300	2,613.00	0.00
409	603899	晨光股份	100	2,063.00	0.00
410	002044	美年健康	400	2,012.00	0.00
411	003035	南网能源	300	1,746.00	0.00
412	688538	和辉光电	300	780.00	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	600549	厦门钨业	27,700	2,360,040.00	0.25
2	601211	国泰海通	114,600	2,085,720.00	0.22
3	600460	士兰微	31,800	1,738,188.00	0.19
4	002653	海思科	24,800	1,645,232.00	0.18
5	000823	超声电子	63,900	1,639,035.00	0.17
6	002384	东山精密	5,800	1,521,630.00	0.16
7	300408	三环集团	8,700	1,452,030.00	0.15
8	000933	神火股份	66,200	1,403,440.00	0.15
9	300566	激智科技	37,900	1,400,405.00	0.15
10	688182	灿勤科技	32,100	1,382,547.00	0.15
11	300213	佳讯飞鸿	220,900	1,338,654.00	0.14
12	688173	希荻微	64,800	1,240,272.00	0.13
13	603006	联明股份	84,900	1,209,825.00	0.13
14	002558	巨人网络	41,500	1,143,740.00	0.12
15	300308	中际旭创	900	1,143,000.00	0.12
16	002737	葵花药业	101,700	1,140,057.00	0.12
17	688012	中微公司	2,400	1,124,400.00	0.12
18	300894	火星人	86,300	1,083,928.00	0.12
19	601187	厦门银行	157,600	1,076,408.00	0.11
20	601886	江河集团	133,900	1,075,217.00	0.11
21	002174	游族网络	84,600	1,066,806.00	0.11
22	002852	道道全	149,800	1,062,082.00	0.11

23	688559	海目星	12,600	1,057,392.00	0.11
24	605111	新洁能	10,600	1,050,884.00	0.11
25	300613	富瀚微	13,100	1,049,048.00	0.11
26	600641	先导基电	24,600	980,556.00	0.10
27	603986	兆易创新	1,200	978,000.00	0.10
28	301061	匠心家居	27,300	957,411.00	0.10
29	600645	中源协和	54,300	929,073.00	0.10
30	300201	海伦哲	43,200	910,224.00	0.10
31	300747	锐科激光	16,600	881,294.00	0.09
32	002156	通富微电	11,550	876,298.50	0.09
33	002947	恒铭达	11,500	874,575.00	0.09
34	301205	联特科技	2,600	868,660.00	0.09
35	000589	贵州轮胎	209,100	848,946.00	0.09
36	000572	海马汽车	228,800	846,560.00	0.09
37	603013	亚普股份	52,300	825,817.00	0.09
38	002245	蔚蓝锂芯	44,100	825,111.00	0.09
39	600229	城市传媒	176,800	820,352.00	0.09
40	000917	电广传媒	120,000	802,800.00	0.09
41	600246	万通发展	42,100	799,900.00	0.09
42	000776	广发证券	33,500	783,900.00	0.08
43	301168	通灵股份	17,300	776,943.00	0.08
44	002080	中材科技	8,400	756,000.00	0.08
45	601872	招商轮船	42,700	750,239.00	0.08
46	688059	华锐精密	3,700	738,927.00	0.08
47	002837	英维克	9,240	735,134.40	0.08
48	002027	分众传媒	149,500	723,580.00	0.08
49	600259	中稀有色	7,100	721,431.00	0.08
50	603083	剑桥科技	2,800	713,636.00	0.08
51	300938	信测标准	14,200	708,296.00	0.08
52	600345	长江通信	10,400	681,304.00	0.07
53	603283	赛腾股份	8,300	672,134.00	0.07
54	000975	山金国际	39,200	666,400.00	0.07
55	688202	美迪西	8,200	661,822.00	0.07
56	603799	华友钴业	13,700	661,162.00	0.07
57	301080	百普赛斯	13,600	652,800.00	0.07
58	300492	华图山鼎	19,000	652,650.00	0.07
59	300331	苏大维格	9,100	647,101.00	0.07
60	300406	九强生物	58,600	640,498.00	0.07
61	688787	海天瑞声	4,700	631,915.00	0.07
62	002810	山东赫达	25,400	627,380.00	0.07
63	688600	皖仪科技	18,700	622,336.00	0.07
64	301122	采纳股份	21,100	620,551.00	0.07
65	300502	新易盛	1,020	619,140.00	0.07

66	300842	帝科股份	6,900	615,273.00	0.07
67	002552	宝鼎科技	10,000	610,000.00	0.07
68	300307	慈星股份	81,600	601,392.00	0.06
69	002379	宏桥控股	40,400	596,708.00	0.06
70	002128	电投能源	25,400	587,248.00	0.06
71	601828	美凯龙	287,500	586,500.00	0.06
72	000792	盐湖股份	19,200	579,648.00	0.06
73	300811	铂科新材	6,100	578,829.00	0.06
74	300863	卡倍亿	7,500	574,725.00	0.06
75	301071	力量钻石	6,200	573,500.00	0.06
76	300363	博腾股份	34,800	565,152.00	0.06
77	688372	伟测科技	3,000	558,000.00	0.06
78	600418	江淮汽车	21,600	557,928.00	0.06
79	002815	崇达技术	32,900	545,811.00	0.06
80	603127	昭衍新药	14,200	542,724.00	0.06
81	300236	上海新阳	4,100	539,150.00	0.06
82	603977	国泰集团	32,500	536,575.00	0.06
83	601375	中原证券	133,600	533,064.00	0.06
84	688275	万润新能	4,100	522,955.00	0.06
85	688046	药康生物	21,400	517,880.00	0.06
86	002532	天山铝业	48,200	517,186.00	0.06
87	600419	天润乳业	68,300	517,031.00	0.06
88	300055	万邦达	80,000	514,400.00	0.05
89	300377	赢时胜	31,300	505,182.00	0.05
90	002111	威海广泰	55,800	502,200.00	0.05
91	603713	密尔克卫	7,000	498,190.00	0.05
92	688717	艾罗能源	6,000	495,420.00	0.05
93	688110	东芯股份	2,400	488,880.00	0.05
94	300767	震安科技	21,900	488,151.00	0.05
95	600226	亨通股份	50,800	487,172.00	0.05
96	001359	平安电工	3,860	483,465.00	0.05
97	688531	日联科技	2,700	480,168.00	0.05
98	002236	大华股份	29,100	479,859.00	0.05
99	600150	中国船舶	14,072	475,492.88	0.05
100	002515	金字火腿	46,900	469,469.00	0.05
101	603124	江南新材	2,500	467,450.00	0.05
102	688388	嘉元科技	10,480	461,120.00	0.05
103	603078	江化微	9,300	459,606.00	0.05
104	688218	江苏北人	8,200	450,672.00	0.05
105	300814	中富电路	2,200	449,900.00	0.05
106	600489	中金黄金	24,800	447,640.00	0.05
107	688041	海光信息	1,200	444,360.00	0.05
108	002093	国脉科技	69,900	440,370.00	0.05

109	300709	精研科技	7,800	438,750.00	0.05
110	002330	得利斯	125,500	434,230.00	0.05
111	600183	生益科技	2,500	433,500.00	0.05
112	000807	云铝股份	19,100	422,874.00	0.05
113	688236	春立医疗	29,000	419,340.00	0.04
114	300860	锋尚文化	16,100	412,160.00	0.04
115	300990	同飞股份	3,900	409,773.00	0.04
116	302132	中航成飞	7,000	408,240.00	0.04
117	000036	华联控股	93,400	408,158.00	0.04
118	600403	大有能源	75,600	399,924.00	0.04
119	603068	博通集成	9,900	398,277.00	0.04
120	688521	芯原股份	1,000	371,140.00	0.04
121	603499	翔港科技	27,800	365,570.00	0.04
122	688799	华纳药厂	8,100	363,447.00	0.04
123	603950	长源东谷	4,300	363,049.00	0.04
124	002115	三维通信	34,600	356,380.00	0.04
125	300438	鹏辉能源	4,200	347,970.00	0.04
126	000657	中钨高新	3,600	344,592.00	0.04
127	002426	胜利精密	85,500	340,290.00	0.04
128	000048	京基智农	15,400	340,186.00	0.04
129	301165	锐捷网络	4,200	337,890.00	0.04
130	601058	赛轮轮胎	28,900	333,217.00	0.04
131	301592	六九一二	2,500	330,875.00	0.04
132	688025	杰普特	700	329,000.00	0.04
133	600011	华能国际	43,100	327,129.00	0.03
134	688141	杰华特	2,100	322,350.00	0.03
135	688256	寒武纪	200	319,110.00	0.03
136	300397	天和防务	20,600	311,884.00	0.03
137	601995	中金公司	8,600	310,890.00	0.03
138	002346	柘中股份	14,400	308,016.00	0.03
139	603507	振江股份	9,200	302,588.00	0.03
140	002975	博杰股份	2,130	302,460.00	0.03
141	002925	盈趣科技	12,200	300,852.00	0.03
142	688259	创耀科技	7,600	297,312.00	0.03
143	300497	富祥股份	13,300	294,728.00	0.03
144	301306	西测测试	1,700	269,433.00	0.03
145	605228	神通科技	20,000	268,600.00	0.03
146	000059	华锦股份	71,400	267,750.00	0.03
147	000869	张裕 A	16,900	263,302.00	0.03
148	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.03
149	002284	亚太股份	27,200	258,128.00	0.03
150	688233	神工股份	1,200	257,304.00	0.03
151	600113	浙江东日	7,700	255,486.00	0.03

152	688390	固德威	2,300	249,573.00	0.03
153	300772	运达股份	19,900	244,770.00	0.03
154	002353	杰瑞股份	1,600	244,000.00	0.03
155	688353	华盛锂电	2,100	243,747.00	0.03
156	002938	鹏鼎控股	2,300	242,374.00	0.03
157	300085	银之杰	6,900	241,293.00	0.03
158	002544	普天科技	13,200	240,504.00	0.03
159	688168	安博通	3,480	239,250.00	0.03
160	002439	启明星辰	18,500	234,025.00	0.02
161	688766	普冉股份	300	229,980.00	0.02
162	300042	朗科科技	3,000	228,510.00	0.02
163	600114	东睦股份	6,000	226,560.00	0.02
164	003010	若羽臣	9,300	225,990.00	0.02
165	002805	丰元股份	7,800	223,002.00	0.02
166	002545	东方铁塔	13,700	222,214.00	0.02
167	000833	粤桂股份	9,400	220,148.00	0.02
168	688820	盛合晶微	1,506	213,083.94	0.02
169	600138	中青旅	32,600	212,878.00	0.02
170	002484	江海股份	2,000	210,000.00	0.02
171	301500	飞南资源	8,000	208,400.00	0.02
172	001338	永顺泰	24,600	206,394.00	0.02
173	002833	弘亚数控	10,600	204,474.00	0.02
174	002415	海康威视	5,800	198,360.00	0.02
175	300671	富满微	2,300	198,168.00	0.02
176	688685	迈信林	3,600	197,640.00	0.02
177	600971	恒源煤电	28,300	195,270.00	0.02
178	301371	敷尔佳	7,200	187,200.00	0.02
179	600027	华电国际	42,000	186,900.00	0.02
180	600030	中信证券	6,500	186,745.00	0.02
181	603931	格林达	3,100	184,140.00	0.02
182	688536	思瑞浦	500	182,045.00	0.02
183	300993	玉马科技	18,500	179,820.00	0.02
184	688386	泛亚微透	2,000	179,680.00	0.02
185	603181	皇马科技	10,700	173,554.00	0.02
186	688239	航宇科技	2,900	173,507.00	0.02
187	000938	紫光股份	6,000	173,160.00	0.02
188	300568	星源材质	9,200	172,224.00	0.02
189	002838	道恩股份	5,600	171,472.00	0.02
190	300393	中来股份	23,500	171,315.00	0.02
191	601985	中国核电	18,700	168,861.00	0.02
192	002285	世联行	81,400	166,870.00	0.02
193	688072	拓荆科技	200	166,400.00	0.02
194	601127	赛力斯	2,700	165,375.00	0.02

195	002396	星网锐捷	8,510	163,136.70	0.02
196	688131	皓元医药	1,700	160,820.00	0.02
197	688503	聚和材料	1,200	159,240.00	0.02
198	688332	中科蓝讯	1,000	157,500.00	0.02
199	688262	国芯科技	3,600	155,628.00	0.02
200	600425	青松建化	46,000	150,420.00	0.02
201	603011	合锻智能	4,500	148,860.00	0.02
202	688525	佰维存储	300	148,419.00	0.02
203	600376	首开股份	43,800	146,292.00	0.02
204	600176	中国巨石	2,000	145,760.00	0.02
205	002518	科士达	2,700	144,693.00	0.02
206	600025	华能水电	16,100	143,129.00	0.02
207	688167	炬光科技	400	141,684.00	0.02
208	301308	江波龙	200	140,760.00	0.02
209	688359	三孚新科	700	138,908.00	0.01
210	603929	亚翔集成	500	136,010.00	0.01
211	601899	紫金矿业	5,400	135,756.00	0.01
212	300556	丝路视觉	7,800	135,486.00	0.01
213	603886	元祖股份	10,600	135,468.00	0.01
214	002364	中恒电气	2,500	134,500.00	0.01
215	300765	石药创新	4,800	130,704.00	0.01
216	601700	风范股份	29,000	126,440.00	0.01
217	605399	晨光新材	8,600	126,334.00	0.01
218	688008	澜起科技	400	123,960.00	0.01
219	002661	克明食品	17,500	121,275.00	0.01
220	603516	淳中科技	900	121,149.00	0.01
221	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
222	300401	花园生物	5,500	120,395.00	0.01
223	002179	中航光电	2,600	120,120.00	0.01
224	301096	百诚医药	2,100	120,099.00	0.01
225	688183	生益电子	900	119,160.00	0.01
226	601918	新集能源	13,800	118,542.00	0.01
227	300870	欧陆通	340	117,534.60	0.01
228	301489	思泉新材	700	115,206.00	0.01
229	001399	惠科股份	4,035	111,890.55	0.01
230	600026	中远海能	6,100	109,434.00	0.01
231	603629	利通电子	600	107,286.00	0.01
232	601877	正泰电器	4,200	105,294.00	0.01
233	688146	中船特气	300	104,997.00	0.01
234	002922	伊戈尔	3,200	104,960.00	0.01
235	603297	永新光学	700	102,865.00	0.01
236	600681	百川能源	31,600	102,068.00	0.01
237	300590	移为通信	7,100	101,885.00	0.01

238	688257	新锐股份	980	99,862.00	0.01
239	000935	四川双马	3,800	99,142.00	0.01
240	688369	致远互联	4,700	98,747.00	0.01
241	002475	立讯精密	1,400	98,560.00	0.01
242	000408	藏格矿业	1,400	97,048.00	0.01
243	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
244	000061	农产品	17,300	96,880.00	0.01
245	688399	硕世生物	2,100	95,319.00	0.01
246	002614	奥佳华	21,400	94,588.00	0.01
247	600189	泉阳泉	12,400	93,372.00	0.01
248	688680	海优新材	2,200	92,400.00	0.01
249	003816	中国广核	23,200	90,712.00	0.01
250	002315	焦点科技	3,800	88,464.00	0.01
251	688663	新风光	1,000	88,460.00	0.01
252	002371	北方华创	100	88,456.00	0.01
253	300909	汇创达	1,500	87,330.00	0.01
254	603259	药明康德	700	87,157.00	0.01
255	688368	晶丰明源	400	86,608.00	0.01
256	601138	工业富联	1,200	86,580.00	0.01
257	300291	百纳千成	17,800	85,974.00	0.01
258	300206	理邦仪器	6,900	84,387.00	0.01
259	301193	家联科技	4,500	83,430.00	0.01
260	300975	商络电子	1,600	82,800.00	0.01
261	002151	北斗星通	2,600	82,550.00	0.01
262	301217	铜冠铜箔	500	82,535.00	0.01
263	000581	威孚高科	4,800	81,696.00	0.01
264	600185	珠免集团	18,100	81,450.00	0.01
265	300271	华宇软件	16,800	80,976.00	0.01
266	000596	古井贡酒	1,000	79,800.00	0.01
267	605060	联德股份	1,400	79,436.00	0.01
268	688981	中芯国际	500	79,410.00	0.01
269	300005	探路者	3,500	79,100.00	0.01
270	000811	冰轮环境	1,400	78,708.00	0.01
271	002747	埃斯顿	2,100	78,393.00	0.01
272	002919	名臣健康	4,100	77,859.00	0.01
273	688449	联芸科技	900	77,679.00	0.01
274	002885	京泉华	1,900	77,634.00	0.01
275	300737	科顺股份	11,800	77,526.00	0.01
276	002803	吉宏股份	3,000	77,520.00	0.01
276	688107	安路科技	1,700	77,520.00	0.01
277	300996	普联软件	7,080	77,101.20	0.01
278	688519	南亚新材	200	76,008.00	0.01
279	688383	新益昌	400	75,216.00	0.01

280	688668	鼎通科技	200	74,660.00	0.01
281	688103	国力电子	1,000	74,410.00	0.01
282	600230	沧州大化	5,700	74,214.00	0.01
283	000863	三湘印象	17,200	72,240.00	0.01
284	688627	精智达	100	71,500.00	0.01
285	605068	明新旭腾	4,200	70,476.00	0.01
286	002595	豪迈科技	1,489	69,387.40	0.01
287	300806	斯迪克	600	67,200.00	0.01
288	601011	宝泰隆	25,600	67,072.00	0.01
289	603936	博敏电子	2,500	66,775.00	0.01
290	603615	茶花股份	4,000	64,600.00	0.01
291	300681	英搏尔	2,200	62,964.00	0.01
292	300786	国林科技	2,500	62,675.00	0.01
293	603966	法兰泰克	7,590	61,858.50	0.01
294	688212	澳华内镜	2,100	61,740.00	0.01
295	000550	江铃汽车	3,800	61,636.00	0.01
296	002422	科伦药业	1,600	61,632.00	0.01
297	600609	金杯汽车	19,600	61,152.00	0.01
298	605168	三人行	1,200	60,768.00	0.01
299	688665	四方光电	900	59,130.00	0.01
300	300745	欣锐科技	1,400	59,108.00	0.01
301	301095	广立微	500	59,025.00	0.01
302	300672	国科微	200	59,000.00	0.01
303	688345	博力威	1,000	58,080.00	0.01
304	300067	安诺其	10,700	57,994.00	0.01
305	688658	悦康药业	4,500	57,870.00	0.01
306	002908	德生科技	9,100	57,603.00	0.01
307	300592	华凯易佰	3,200	56,640.00	0.01
308	300575	中旗股份	11,500	56,580.00	0.01
309	688232	新点软件	3,100	55,118.00	0.01
310	688100	威胜信息	1,800	55,062.00	0.01
311	600989	宝丰能源	2,700	54,891.00	0.01
312	002001	新 和 成	1,900	53,998.00	0.01
313	300318	博晖创新	12,900	53,922.00	0.01
314	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
315	603096	新经典	4,000	53,520.00	0.01
316	601061	中信金属	4,900	52,773.00	0.01
317	000630	铜陵有色	8,100	51,516.00	0.01
318	002531	天顺风能	6,000	50,580.00	0.01
319	002955	鸿合科技	1,400	50,050.00	0.01
320	603999	读者传媒	9,900	49,500.00	0.01
321	000338	潍柴动力	1,800	49,050.00	0.01
322	002401	中远海科	4,200	48,762.00	0.01

323	600522	中天科技	800	48,544.00	0.01
324	001311	多利科技	2,980	48,067.40	0.01
325	603588	高能环境	2,500	48,000.00	0.01
326	002405	四维图新	7,200	46,584.00	0.00
327	601168	西部矿业	1,714	46,517.96	0.00
328	002643	万润股份	2,200	46,090.00	0.00
329	002916	深南电路	100	45,790.00	0.00
330	000156	华数传媒	7,200	45,432.00	0.00
331	601288	农业银行	7,400	44,918.00	0.00
332	002238	天威视讯	8,300	44,820.00	0.00
333	603758	秦安股份	5,000	44,700.00	0.00
334	301589	诺瓦星云	300	44,694.00	0.00
335	301487	盟固利	2,300	44,045.00	0.00
336	601898	中煤能源	3,600	43,848.00	0.00
337	300513	恒实科技	6,000	43,440.00	0.00
338	301198	喜悦智行	3,200	42,880.00	0.00
339	605333	沪光股份	2,500	42,625.00	0.00
340	600963	岳阳林纸	14,000	42,560.00	0.00
341	688123	聚辰股份	200	42,520.00	0.00
342	002110	三钢闽光	14,700	42,336.00	0.00
343	300596	利安隆	800	41,984.00	0.00
344	601069	西部黄金	1,900	41,800.00	0.00
345	688267	中触媒	2,080	40,976.00	0.00
346	688699	明微电子	500	40,975.00	0.00
347	002602	世纪华通	2,900	40,890.00	0.00
348	300323	华灿光电	2,000	40,800.00	0.00
349	300226	上海钢联	2,660	40,724.60	0.00
350	688015	交控科技	2,600	39,988.00	0.00
351	301239	普瑞眼科	1,300	39,585.00	0.00
352	688628	优利德	400	39,576.00	0.00
353	002937	兴瑞科技	900	39,537.00	0.00
354	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
355	300750	宁德时代	100	39,301.00	0.00
356	688378	奥来德	629	38,998.00	0.00
357	301626	苏州天脉	100	38,396.00	0.00
358	601858	中国科传	2,200	38,082.00	0.00
359	002824	和胜股份	1,100	38,038.00	0.00
360	600900	长江电力	1,400	37,058.00	0.00
361	301382	蜂助手	800	36,800.00	0.00
362	000410	沈阳机床	7,900	36,656.00	0.00
363	001323	慕思股份	2,300	36,340.00	0.00
364	600037	歌华有线	5,700	35,739.00	0.00
365	600409	三友化工	5,800	35,438.00	0.00

366	301510	固高科技	1,100	35,123.00	0.00
367	603085	天成自控	3,200	34,784.00	0.00
368	300476	胜宏科技	100	34,643.00	0.00
369	688339	亿华通	1,800	33,660.00	0.00
370	688221	前沿生物	1,500	33,600.00	0.00
371	688305	科德数控	500	32,635.00	0.00
372	301196	唯科科技	260	32,609.20	0.00
373	600284	浦东建设	6,700	32,562.00	0.00
374	600007	中国国贸	1,700	32,266.00	0.00
375	301216	万凯新材	1,400	32,186.00	0.00
376	301102	兆讯传媒	3,700	31,635.00	0.00
377	688768	容知日新	600	30,924.00	0.00
378	002646	天佑德酒	4,900	30,919.00	0.00
379	600773	西藏城投	2,400	30,888.00	0.00
380	603726	朗迪集团	900	30,825.00	0.00
381	300629	新劲刚	1,400	30,044.00	0.00
382	601939	建设银行	3,100	29,853.00	0.00
383	600115	中国东航	7,800	29,718.00	0.00
384	300955	嘉亨家化	800	28,872.00	0.00
385	300365	恒华科技	6,300	28,854.00	0.00
386	301511	德福科技	200	28,770.00	0.00
387	603187	海容冷链	2,500	28,725.00	0.00
388	688611	杭州柯林	400	28,580.00	0.00
389	603197	保隆科技	1,000	27,940.00	0.00
390	301326	捷邦科技	200	27,874.00	0.00
391	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
392	000990	诚志股份	3,400	27,812.00	0.00
393	688618	三旺通信	900	27,693.00	0.00
394	688225	亚信安全	2,200	27,324.00	0.00
395	300760	迈瑞医疗	200	27,166.00	0.00
396	688087	英科再生	800	26,736.00	0.00
397	688667	菱电电控	200	26,730.00	0.00
398	300369	绿盟科技	4,900	26,656.00	0.00
399	603132	金徽股份	1,700	26,486.00	0.00
400	688319	欧林生物	600	26,388.00	0.00
401	603317	天味食品	2,000	26,020.00	0.00
402	300732	设研院	4,600	25,622.00	0.00
403	600308	华泰股份	8,500	25,415.00	0.00
404	603678	火炬电子	300	24,900.00	0.00
405	603112	华翔股份	1,400	23,422.00	0.00
406	688197	首药控股	700	23,387.00	0.00
407	601077	渝农商行	3,800	23,218.00	0.00
408	002768	国恩股份	444	23,114.64	0.00

409	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
410	002240	盛新锂能	500	22,415.00	0.00
411	688023	安恒信息	600	22,032.00	0.00
412	000799	酒鬼酒	500	21,850.00	0.00
413	300648	星云股份	500	21,610.00	0.00
414	601068	中铝国际	5,000	21,600.00	0.00
415	600386	北巴传媒	6,800	21,216.00	0.00
416	002228	合兴包装	7,200	21,168.00	0.00
417	000576	甘化科工	3,200	21,024.00	0.00
418	300866	安克创新	200	20,900.00	0.00
419	301162	国能日新	460	20,125.00	0.00
420	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
421	688656	浩欧博	200	19,354.00	0.00
422	002870	香山股份	500	19,270.00	0.00
423	603663	三祥新材	200	19,260.00	0.00
424	688800	瑞可达	200	19,194.00	0.00
425	688176	亚虹医药	1,900	18,848.00	0.00
426	600219	南山铝业	4,700	18,753.00	0.00
427	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
428	605577	龙版传媒	2,100	18,501.00	0.00
429	688310	迈得医疗	1,200	18,444.00	0.00
430	001337	四川黄金	500	18,330.00	0.00
431	301062	上海艾录	3,200	18,272.00	0.00
432	300762	上海瀚讯	400	18,260.00	0.00
433	300820	英杰电气	200	18,046.00	0.00
434	688596	正帆科技	226	17,867.56	0.00
435	603166	福达股份	1,300	17,381.00	0.00
436	688433	华曙高科	200	17,120.00	0.00
437	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
438	688588	凌志软件	1,800	16,362.00	0.00
439	600168	武汉控股	4,000	16,160.00	0.00
440	000880	潍柴重机	700	16,107.00	0.00
441	688157	松井股份	600	15,834.00	0.00
442	300661	圣邦股份	110	15,782.80	0.00
443	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
444	301221	光庭信息	520	15,345.20	0.00
445	000930	中粮科技	3,600	15,300.00	0.00
446	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
447	000617	中油资本	2,300	15,157.00	0.00
448	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
449	603798	康普顿	1,100	15,048.00	0.00
450	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
451	002073	软控股份	2,900	14,906.00	0.00

452	000600	建投能源	1,700	14,875.00	0.00
453	002158	汉钟精机	400	14,832.00	0.00
454	301631	壹连科技	200	14,372.00	0.00
455	688085	三友医疗	1,200	14,364.00	0.00
456	000973	佛塑科技	1,000	14,350.00	0.00
457	300257	开山股份	500	14,340.00	0.00
458	688510	航亚科技	600	14,328.00	0.00
459	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
460	002702	海欣食品	3,100	13,795.00	0.00
461	603380	易德龙	300	13,527.00	0.00
462	601949	中国出版	2,900	13,485.00	0.00
463	601919	中远海控	1,000	13,260.00	0.00
464	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
465	600803	新奥股份	800	12,640.00	0.00
466	300398	飞凯材料	200	12,350.00	0.00
467	605599	菜百股份	900	12,330.00	0.00
468	688091	上海谊众	300	12,060.00	0.00
469	600426	华鲁恒升	500	11,960.00	0.00
470	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
471	301286	侨源股份	200	11,598.00	0.00
472	601816	京沪高铁	2,500	11,325.00	0.00
473	300298	三诺生物	800	11,160.00	0.00
474	601968	宝钢包装	2,800	10,976.00	0.00
475	601100	恒立液压	100	10,756.00	0.00
476	002891	中宠股份	400	10,688.00	0.00
477	603707	健友股份	1,500	10,605.00	0.00
478	688302	海创药业	300	10,551.00	0.00
479	603528	多伦科技	1,800	10,548.00	0.00
480	688311	盟升电子	400	10,476.00	0.00
481	688398	赛特新材	400	10,364.00	0.00
482	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
483	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
484	300597	吉大通信	1,400	9,912.00	0.00
485	000426	兴业银锡	300	9,888.00	0.00
486	605507	国邦医药	660	9,768.00	0.00
487	605158	华达新材	1,500	9,600.00	0.00
488	002912	中新赛克	500	9,220.00	0.00
489	600096	云天化	300	9,120.00	0.00
490	600676	交运股份	1,400	9,086.00	0.00
491	600446	金证股份	900	9,054.00	0.00
492	002483	润邦股份	1,800	8,892.00	0.00
493	600782	新钢股份	3,500	8,680.00	0.00
494	300706	阿石创	100	8,635.00	0.00

495	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
496	300059	东方财富	400	8,152.00	0.00
497	000568	泸州老窖	100	7,752.00	0.00
498	002745	木林森	600	7,530.00	0.00
499	002589	瑞康医药	3,000	7,380.00	0.00
500	600580	卧龙电驱	220	7,282.00	0.00
501	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
502	603993	洛阳钼业	400	7,020.00	0.00
503	605222	起帆电缆	300	6,996.00	0.00
504	000065	北方国际	700	6,881.00	0.00
505	600116	三峡水利	1,200	6,720.00	0.00
506	301060	兰卫医学	800	6,536.00	0.00
507	601126	四方股份	100	6,320.00	0.00
508	001376	百通能源	600	6,240.00	0.00
509	688522	纳睿雷达	300	6,006.00	0.00
510	688586	江航装备	500	5,845.00	0.00
511	688552	航天南湖	200	5,626.00	0.00
512	603010	万盛股份	300	5,436.00	0.00
513	003020	立方制药	360	5,331.60	0.00
514	603906	龙蟠科技	200	5,306.00	0.00
515	688548	广钢气体	100	5,210.00	0.00
516	603706	东方环宇	300	5,187.00	0.00
517	601519	大智慧	600	5,178.00	0.00
518	605286	同力天启	200	5,098.00	0.00
519	300025	华星创业	1,200	5,040.00	0.00
520	603277	银都股份	500	4,990.00	0.00
521	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
522	603676	卫信康	600	4,830.00	0.00
523	600643	爱建集团	1,300	4,823.00	0.00
524	603258	电魂网络	400	4,796.00	0.00
525	002362	汉王科技	300	4,665.00	0.00
526	600201	生物股份	400	4,660.00	0.00
527	601579	会稽山	300	4,407.00	0.00
528	300129	泰胜风能	500	4,275.00	0.00
529	603138	海量数据	300	4,215.00	0.00
530	002635	安洁科技	200	4,090.00	0.00
531	300416	苏试试验	200	4,076.00	0.00
532	600724	宁波富达	800	4,056.00	0.00
533	002221	东华能源	700	3,682.00	0.00
534	601868	中国能建	1,300	3,471.00	0.00
535	688177	百奥泰	200	3,364.00	0.00
536	600673	东阳光	100	3,358.00	0.00
537	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00

538	300696	爱乐达	100	2,603.00	0.00
539	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
540	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
541	002654	万润科技	100	2,226.00	0.00
542	600718	东软集团	300	2,172.00	0.00
543	002949	华阳国际	200	1,978.00	0.00
544	000710	贝瑞基因	200	1,492.00	0.00
545	603158	腾龙股份	100	1,223.00	0.00
546	002104	恒宝股份	100	1,031.00	0.00
547	002676	顺威股份	200	996.00	0.00
548	600075	新疆天业	200	808.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002532	天山铝业	16,262,356.02	1.79
2	002738	中矿资源	16,251,843.20	1.79
3	300857	协创数据	16,241,238.40	1.79
4	300604	长川科技	16,154,032.00	1.78
5	300395	菲利华	16,095,343.00	1.77
6	300136	信维通信	14,989,986.00	1.65
7	600549	厦门钨业	14,700,647.40	1.62
8	002185	华天科技	14,067,854.11	1.55
9	002353	杰瑞股份	13,951,595.02	1.53
10	000657	中钨高新	13,725,074.00	1.51
11	688347	华虹宏力	13,708,956.49	1.51
12	002138	顺络电子	13,314,960.00	1.46
13	300223	北京君正	13,304,340.00	1.46
14	688629	华丰科技	13,050,352.91	1.43
15	002156	通富微电	12,947,319.00	1.42
16	002281	光迅科技	12,888,366.00	1.42
17	300037	新宙邦	12,845,284.00	1.41
18	300373	扬杰科技	12,721,303.38	1.40
19	002008	大族激光	12,531,427.49	1.38
20	000933	神火股份	12,220,439.00	1.34

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	600487	亨通光电	25,056,079.20	2.75
2	002008	大族激光	23,044,708.00	2.53
3	002156	通富微电	21,372,815.00	2.35

4	600549	厦门钨业	21,337,493.06	2.35
5	002281	光迅科技	19,471,894.12	2.14
6	002532	天山铝业	19,017,221.00	2.09
7	300136	信维通信	18,759,466.00	2.06
8	002353	杰瑞股份	17,943,549.00	1.97
9	000657	中钨高新	16,127,314.60	1.77
10	600118	中国卫星	15,775,794.59	1.73
11	601168	西部矿业	15,748,951.00	1.73
12	300285	国瓷材料	15,285,532.00	1.68
13	000933	神火股份	15,167,314.00	1.67
14	300390	天华新能	14,874,490.10	1.64
15	002558	巨人网络	14,427,080.00	1.59
16	300058	蓝色光标	13,984,938.60	1.54
17	300604	长川科技	13,920,883.00	1.53
18	300857	协创数据	13,839,133.40	1.52
19	600988	赤峰黄金	13,703,521.00	1.51
20	688525	佰维存储	13,392,204.10	1.47

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,025,171,236.42
卖出股票收入（成交）总额	3,195,007,252.88

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	186,664.17	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	186,664.17	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111025	圣泉转债	970	97,001.28	0.01
2	113704	春风转债	570	57,002.62	0.01
3	118071	华峰转债	240	24,000.42	0.00
4	127114	宣化转债	33	3,300.07	0.00
5	113703	翔 26 转债	30	3,000.30	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

浙江春风动力股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方海关处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内未出现被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	5,760,682.06
2	应收清算款	148,836.81
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,888,117.58
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,797,636.45

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 500 指数增强 A	26,538	8,884.99	11,007,548.77	4.67	224,782,441.59	95.33
景顺长城 中证 500 指数增强 C	2,881	89,141.99	233,838,150.46	91.05	22,979,912.48	8.95
合计	29,419	16,744.55	244,845,699.23	49.70	247,762,354.07	50.30

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 500 指数增强 A	56,492.68	0.023959
	景顺长城中证 500 指数增强 C	15.34	0.000006
	合计	56,508.02	0.011471

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	景顺长城中证 500 指数增强 A	—
	景顺长城中证 500 指数增强 C	—
	合计	—
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城中证 500 指数增强 A	0~10
	景顺长城中证 500 指数增强 C	—
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2019 年 3 月 25 日）基金份额总额	1,508,879,568.71	—
本报告期期初基金份额总额	312,343,285.30	283,110,681.09
本报告期基金总申购份额	87,701,329.96	367,779,010.42
减：本报告期基金总赎回份额	164,254,624.90	394,071,628.57
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份	235,789,990.36	256,818,062.94

额总额		
-----	--	--

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，无涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券股份有限公司	1	3,026,756,938.19	48.67	590,218.17	48.67	未变更
中信证券股份有限公司	4	1,640,629,461.36	26.38	319,941.88	26.38	未变更
中国国际金融股份有限公司	1	1,550,951,199.49	24.94	302,449.65	24.94	未变更
长城证券股份有限公司	3	—	—	—	—	未变更
德邦证券股份有限公司	1	—	—	—	—	未变更
东方证券股份有限公司	2	—	—	—	—	未变更
东吴证券股份有限公司	1	—	—	—	—	未变更
东兴证券股份有限公司	1	—	—	—	—	未变更
广发证券股份有限公司	2	—	—	—	—	未变更
国盛证券股份有限公司	1	—	—	—	—	未变更
国泰海通证券股份有限公司	2	—	—	—	—	未变更
华福证券股份有限公司	1	—	—	—	—	未变更
华西证券股份有限公司	1	—	—	—	—	未变更
平安证券	1	—	—	—	—	未变

股份有限 公司						更
信达证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	本期 报告 退租 1 个
招商证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	未变 更
浙商证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
中国银河 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	未变 更
中泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
中信建投 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	未变 更

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

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
华泰证券 股份有限 公司	183,381.22	64.97	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份	98,882.52	35.03	-	-	-	-

有限公司						
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-

证券股份 有限公司						
中泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 20 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 22 日
3	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 22 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 27 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华西证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 5 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 25 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 26 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 25 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 27 日
10	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 27 日
11	景顺长城基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 31 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 7 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 21 日
14	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 22 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报刊及	2026 年 4 月 22 日

	基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	网站	
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 29 日
17	2025 年度景顺长城基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 29 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 12 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于部分基金投顾组合终止的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 13 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 21 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 22 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 27 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 29 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 2 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 9 日
26	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增排排网销售为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 22 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 23 日
28	景顺长城基金管理有限公司关于暂停浦领基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 24 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20260101-20 260107	120,666, 158.43	-	120,666, 158.43	-	-
	2	20260101-20 260204;2026 0326-202604 26	133,732, 181.80	-	133,732, 181.80	-	-
	3	20260204-20 260615	-	158,134, 432.66	63,450,0 87.58	94,684, 345.08	19.22

产品特有风险

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

1、大额申购风险

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

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

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

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

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

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

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

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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城中证 500 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 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 500 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

2026 年 8 月 28 日