

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 23 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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 21 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 2019 年 01 月 01 日起至 2019 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
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	48

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	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	50
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 500ETF
场内简称	景顺 500
基金主代码	159935
交易代码	159935
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 26 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	210,572,956.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014 年 1 月 21 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以中证 500 指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	中证 500 指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	王永民
	联系电话	0755-82370388	010-66594896

电子邮箱	investor@igwfm.com	fcid@bankofchina.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	丁益	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	-11,567,414.44
本期利润	44,087,588.52
加权平均基金份额本期利润	0.2169
本期加权平均净值利润率	15.70%
本期基金份额净值增长率	19.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	79,722,798.03
期末可供分配基金份额利润	0.3786
期末基金资产净值	290,295,754.03
期末基金份额净值	1.3786
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	37.86%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

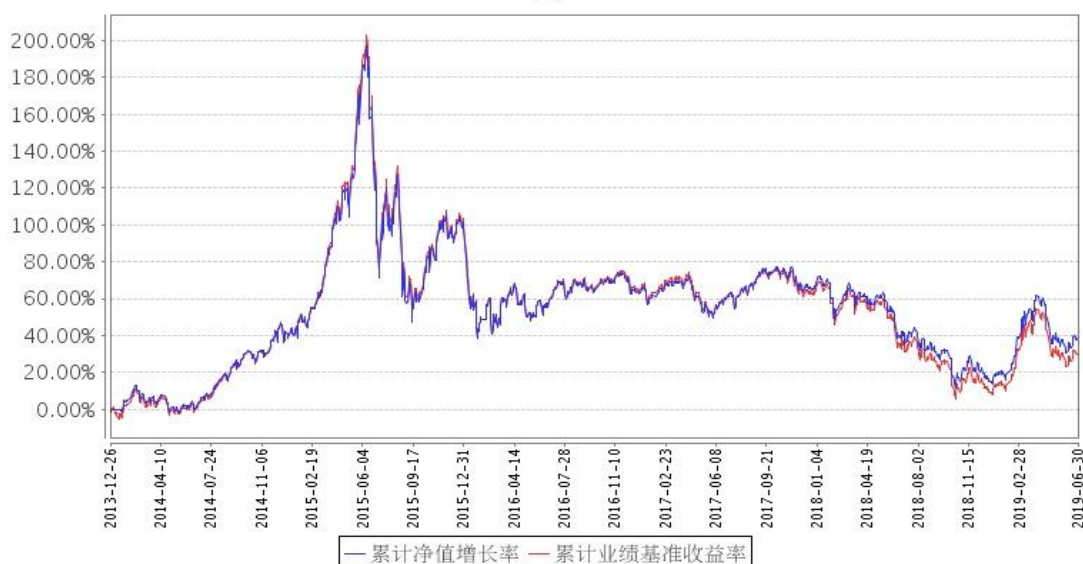
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.00%	1.36%	0.78%	1.39%	0.22%	-0.03%
过去三个月	-9.82%	1.78%	-10.76%	1.81%	0.94%	-0.03%
过去六个月	19.69%	1.75%	18.77%	1.79%	0.92%	-0.04%
过去一年	-2.76%	1.64%	-5.12%	1.69%	2.36%	-0.05%
过去三年	-14.15%	1.28%	-19.16%	1.31%	5.01%	-0.03%
自基金合同生效起至今	37.86%	1.77%	29.99%	1.80%	7.87%	-0.03%

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

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



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

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“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。

截至2019年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理75只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证TMT150交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证TMT150交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基

金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化小盘股票型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金、景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景泰鑫利纯债债券型证券投资基金、景顺长城智能生活混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金、景顺长城集英成长两年定期开放混合型证券投资基金、景顺长城量化港股通股票型证券投资基金、景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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		
曾理	本基金的基金经理	2018 年 10 月 12 日	-	5	工学硕士。曾任职于腾讯计算机系统有限公司信息安全部产品策略岗位。2014 年 8 月加入本公司，历任量化及 ETF 投资部量化程序员、量化及指数投资部基金经理助理，自 2018 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理。
徐喻军	本基金的基金经理、量化及指数投资部总监助理	2014 年 12 月 27 日	-	9	理学硕士。曾担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，现担任量化及指数投资部总监助理兼基金经理。
--	--	--	--	--	-----------------------------

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金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 57 次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，公司旗下指数基金因指数成份股调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间虽然存在临近交易日同向交易行为，但结合交易时机及市场交易价格波动分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。投资组合间虽然存在相邻反向异常交易，经分析为投资组合开放期内投资者连续赎回导致的被动行为，非不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2019 年 6 月工业增加值累计增长 6.0%，增速持平，6 月 PMI 指数环比下降至 49.4，经济经历短期企稳后再度显示出疲态。6 月 PPI 同比 0%，环比下跌 0.3%；6 月 CPI 同比上涨 2.7%，环比下跌 0.1%，通胀预期维持平稳。6 月 M2 同比增速 8.5%，M1 同比增速 4.4%，社会融资规模存量同比增长 10.9%，增速维持平稳。6 月末外汇储备 3.1 万亿美元，受贸易摩擦影响，汇率波动加大。今年初在稳增长和宽信用的金融政策引导下，市场情绪较为乐观，A 股迎来一波明显的估值修复行情。2 季度开始，中美贸易摩擦的加剧和美国对华为等公司的禁令，超出市场预期，引发投资者对贸易摩擦和科技竞争的担忧，对企业基本面悲观预期加重，市场在冲高后加速回落进入震荡调整阶段。上半年上证综指、沪深 300 和创业板指数分别上涨 19.45%，27.07%和 20.87%。

本基金采用完全复制中证 500 指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019 年上半年，本基金份额净值增长率为 19.69%，业绩比较基准收益率为 18.77%。报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，跟踪误差（年化）控制在 2%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年下半年，全球经济面临增长放缓的风险，国内经济仍然存在下行压力。但随着中美贸易摩擦走向缓和，可能会有最终方案落地。宽信用和稳增长货币政策延续，基建投资反弹，房地产投资增速回升，减税降费的实施，对经济基本面有较强支持。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在供给侧改革和产业升级的背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前市场整体估值仍然处于合理位置，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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、

时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,534,574.43	5,392,912.32
结算备付金		-	-
存出保证金		1,385.40	2,427.67
交易性金融资产	6.4.7.2	283,990,033.99	221,569,500.89
其中：股票投资		283,990,033.99	221,569,500.89
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		166,720.30	40,158.52
应收利息	6.4.7.5	1,438.62	1,074.84
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		290,694,152.74	227,006,074.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		117,150.51	99,792.94
应付托管费		23,430.11	19,958.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	80,707.18	62,619.02
应交税费		-	0.07
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	177,110.91	410,000.00
负债合计		398,398.71	592,370.62
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	210,572,956.00	196,572,956.00
未分配利润	6.4.7.10	79,722,798.03	29,840,747.62
所有者权益合计		290,295,754.03	226,413,703.62
负债和所有者权益总计		290,694,152.74	227,006,074.24

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3786 元，基金份额总额 210,572,956.00 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		45,280,992.33	-45,255,480.51
1. 利息收入		23,096.18	29,570.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	23,084.22	29,570.67
债券利息收入		11.96	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,398,168.81	3,211,600.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-13,082,742.13	1,238,084.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,769.34	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,678,803.98	1,973,515.15

3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	55,655,002.96	-48,492,719.38
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	1,062.00	-3,931.80
减: 二、费用		1,193,403.81	1,333,239.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	692,409.07	749,284.41
2. 托管费	6.4.10.2.2	138,481.82	149,856.86
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	135,391.40	125,262.29
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.03	-
7. 其他费用	6.4.7.19	227,121.49	308,836.27
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		44,087,588.52	-46,588,720.34
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		44,087,588.52	-46,588,720.34

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	196,572,956.00	29,840,747.62	226,413,703.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	44,087,588.52	44,087,588.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	14,000,000.00	5,794,461.89	19,794,461.89
其中: 1. 基金申购款	14,000,000.00	5,794,461.89	19,794,461.89
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-

五、期末所有者权益(基金净值)	210,572,956.00	79,722,798.03	290,295,754.03
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	186,572,956.00	124,327,057.45	310,900,013.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-46,588,720.34	-46,588,720.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	4,000,000.00	1,888,988.14	5,888,988.14
其中：1. 基金申购款	12,000,000.00	7,132,217.66	19,132,217.66
2. 基金赎回款	-8,000,000.00	-5,243,229.52	-13,243,229.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	190,572,956.00	79,627,325.25	270,200,281.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1501 号《关于核准景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 512,538,347.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 887 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 26 日正式生效,基金合同

生效日的基金份额总额为 512,572,956.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 34,609.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2014]第 17 号文审核同意，本基金 512,572,956.00 份基金份额于 2014 年 1 月 21 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 500 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

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

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2019 年 8 月 21 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变

动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按

50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2019 年 6 月 30 日
活期存款	6,534,574.43
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月至 1 年	-
存款期限 1 年以上	-
其他存款	-
合计	6,534,574.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	330,969,561.48	283,990,033.99	-46,979,527.49
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	330,969,561.48	283,990,033.99	-46,979,527.49

注：于 2019 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 0.00 元。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,438.08
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.54
合计	1,438.62

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	80,707.18
银行间市场应付交易费用	-
合计	80,707.18

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	126,550.91
应付指数使用费	50,000.00
其他	560.00
合计	177,110.91

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	196,572,956.00	196,572,956.00
本期申购	14,000,000.00	14,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
- 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	210,572,956.00	210,572,956.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	225,082,432.12	-195,241,684.50	29,840,747.62
本期利润	-11,567,414.44	55,655,002.96	44,087,588.52
本期基金份额交易产生的变动数	16,098,519.52	-10,304,057.63	5,794,461.89
其中：基金申购款	16,098,519.52	-10,304,057.63	5,794,461.89
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	229,613,537.20	-149,890,739.17	79,722,798.03

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	22,451.80
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	609.79
其他	22.63
合计	23,084.22

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-13,082,742.13
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-13,082,742.13

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
----	----------------------------

卖出股票成交总额	46,684,621.25
减：卖出股票成本总额	59,767,363.38
买卖股票差价收入	-13,082,742.13

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	53,981.59
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	48,200.00
减：应收利息总额	12.25
买卖债券差价收入	5,769.34

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,678,803.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,678,803.98

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	55,655,002.96
股票投资	55,655,002.96
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	55,655,002.96

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

0.00 元。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,062.00
合计	1,062.00

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	135,391.40
银行间市场交易费用	-
合计	135,391.40

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	67,045.35
银行划款手续费	570.58
指数使用费	100,000.00
上市费	29,752.78
合计	227,121.49

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金销售机构
景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“景顺长城中证 500ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	38,384,100.29	43.34	33,021,867.99	40.85

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内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 2019年1月1日至2019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	35,745.67	43.34	34,881.22	43.22
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	30,752.03	40.85	29,120.43	41.51

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	692,409.07	749,284.41
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	138,481.82	149,856.86

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

日托管费=前一日基金资产净值 X0.10%/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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2019 年 6 月 30 日		2018 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
景顺长城中证 500ETF 联接基金	206,000,000.00	97.83	186,000,000.00	97.60

6.4.10.5 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	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 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	6,534,574.43	22,451.80	10,321,440.27	28,760.29

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券（上年末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的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。

本基金管理人通过由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，并按照合约规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 2019年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,534,574.43	-	-	-	-	-	6,534,574.43
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	1,385.40	-	-	-	-	-	1,385.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	283,990,033.99	283,990,033.99
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,438.62	1,438.62
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	166,720.30	166,720.30
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,535,959.83	-	-	-	-	284,158,192.91	290,694,152.74
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	117,150.51	117,150.51
应付托管费	-	-	-	-	-	23,430.11	23,430.11
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	80,707.18	80,707.18
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	177,110.91	177,110.91
负债总计	-	-	-	-	-	398,398.71	398,398.71
利率敏感度缺口	6,535,959.83	-	-	-	-	-	-
上年度末 2018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							
银行存款	5,392,912.32	-	-	-	-	-	5,392,912.32
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	2,427.67	-	-	-	-	-	2,427.67
交易性金融资产	-	-	-	-	-	221,569,500.89	221,569,500.89
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,074.84	1,074.84
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	40,158.52	40,158.52
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,395,339.99	-	-	-	-	221,610,734.25	227,006,074.24
负债							

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	99,792.94	99,792.94
应付托管费	-	-	-	-	19,958.59	19,958.59
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	62,619.02	62,619.02
应付利息	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	0.07	0.07
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	410,000.00	410,000.00
负债总计	-	-	-	-	592,370.62	592,370.62
利率敏感度缺口	5,395,339.99	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有债券资产（上年末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：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。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。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。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

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 2019年6月30日		上年度末 2018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	283,990,033.99	97.83	221,569,500.89	97.86
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-

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	283,990,033.99	97.83	221,569,500.89	97.86

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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	14,445,573.50	10,516,329.49
	沪深 300 指数下降 5%	-14,445,573.50	-10,516,329.49

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 283,933,057.45 元，属于第二层次的余额为 56,976.54 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 220,219,788.69 元，第二层次 1,349,712.20 元，属于第三层次的余额为 0.00 元)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输

入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 基金申购款

于 2019 年上半年，本基金申购基金份额的对价总额为 19,794,461.89 元(于 2018 年上半年：19,132,217.66 元)，其中包括以股票支付的申购款 19,536,787.00 元和以现金支付的申购款 257,674.89 元(2018 年上半年：其中包括以股票支付的申购款 18,131,797.40 元和以现金支付的申购款 1,000,420.26 元)。

(3) 其他

除公允价值和基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	283,990,033.99	97.69
	其中：股票	283,990,033.99	97.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,534,574.43	2.25
8	其他各项资产	169,544.32	0.06
9	合计	290,694,152.74	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	3,140,281.00	1.08
B	采矿业	10,039,000.85	3.46
C	制造业	158,137,866.64	54.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,004,161.42	3.10
E	建筑业	5,042,495.46	1.74
F	批发和零售业	15,048,013.41	5.18
G	交通运输、仓储和邮政业	9,429,124.44	3.25
H	住宿和餐饮业	1,091,266.00	0.38
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,305,433.10	9.41
J	金融业	12,721,112.44	4.38
K	房地产业	13,304,289.53	4.58
L	租赁和商务服务业	3,894,370.74	1.34
M	科学研究和技术服务业	395,187.30	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	2,524,231.24	0.87
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	955,879.80	0.33
Q	卫生和社会工作	1,735,485.00	0.60
R	文化、体育和娱乐业	5,891,675.89	2.03
S	综合	3,876,215.00	1.34
	合计	283,536,089.26	97.67

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	180,457.15	0.06
C	制造业	176,907.28	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.01
J	金融业	33,869.94	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	453,944.73	0.16

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	002405	四维图新	121,800	1,960,980.00	0.68
2	000860	顺鑫农业	38,514	1,796,678.10	0.62
3	600872	中炬高新	41,350	1,771,020.50	0.61
4	002157	正邦科技	87,900	1,464,414.00	0.50
5	002049	紫光国微	31,500	1,389,465.00	0.48
6	300253	卫宁健康	96,230	1,364,541.40	0.47
7	600201	生物股份	85,987	1,349,136.03	0.46
8	000066	中国长城	130,621	1,342,783.88	0.46
9	002195	二三四五	342,422	1,332,021.58	0.46
10	600739	辽宁成大	90,800	1,320,232.00	0.45
11	300450	先导智能	39,200	1,317,120.00	0.45
12	600763	通策医疗	14,300	1,266,837.00	0.44
13	002506	协鑫集成	187,900	1,255,172.00	0.43
14	600426	华鲁恒升	84,456	1,255,016.16	0.43
15	002439	启明星辰	46,500	1,250,850.00	0.43
16	002507	涪陵榨菜	41,000	1,250,500.00	0.43
17	000401	冀东水泥	70,017	1,232,999.37	0.42
18	002127	南极电商	109,200	1,227,408.00	0.42
19	002463	沪电股份	89,499	1,218,976.38	0.42
20	600642	申能股份	202,600	1,217,626.00	0.42
21	002129	中环股份	123,900	1,209,264.00	0.42
22	600183	生益科技	78,660	1,183,833.00	0.41
23	600536	中国软件	21,967	1,178,968.89	0.41
24	600895	张江高科	57,400	1,177,848.00	0.41
25	600298	安琪酵母	36,700	1,160,821.00	0.40
26	002340	格林美	246,342	1,160,270.82	0.40
27	300383	光环新网	68,500	1,148,745.00	0.40
28	000975	银泰资源	86,924	1,146,527.56	0.39

29	002465	海格通信	119,800	1,142,892.00	0.39
30	000623	吉林敖东	69,100	1,132,549.00	0.39
31	000750	国海证券	218,900	1,101,067.00	0.38
32	002223	鱼跃医疗	44,626	1,098,692.12	0.38
33	002268	卫士通	43,520	1,064,064.00	0.37
34	002384	东山精密	71,519	1,042,031.83	0.36
35	603369	今世缘	37,200	1,037,508.00	0.36
36	002075	沙钢股份	130,900	1,026,256.00	0.35
37	600801	华新水泥	50,551	1,023,657.75	0.35
38	002926	华西证券	97,300	1,021,650.00	0.35
39	002500	山西证券	125,900	1,019,790.00	0.35
40	002821	凯莱英	10,300	1,010,224.00	0.35
41	002385	大北农	188,800	998,752.00	0.34
42	600161	天坛生物	39,522	997,930.50	0.34
43	600879	航天电子	161,292	993,558.72	0.34
44	000998	隆平高科	68,300	988,984.00	0.34
45	002797	第一创业	155,900	988,406.00	0.34
46	600325	华发股份	125,612	981,029.72	0.34
47	600460	士兰微	58,342	968,477.20	0.33
48	600497	驰宏锌锗	188,800	959,104.00	0.33
49	600528	中铁工业	82,400	953,368.00	0.33
50	000723	美锦能源	91,100	951,995.00	0.33
51	002373	千方科技	55,200	943,920.00	0.33
52	000988	华工科技	59,659	943,805.38	0.33
53	600745	闻泰科技	28,400	943,448.00	0.32
54	601128	常熟银行	122,000	941,840.00	0.32
55	002371	北方华创	13,552	938,476.00	0.32
56	600848	上海临港	30,000	933,900.00	0.32
57	002299	圣农发展	36,800	931,776.00	0.32
58	600779	水井坊	18,200	924,924.00	0.32
59	000778	新兴铸管	207,300	920,412.00	0.32
60	600584	长电科技	71,394	917,412.90	0.32
61	000686	东北证券	104,100	917,121.00	0.32
62	000997	新大陆	54,252	916,316.28	0.32
63	000009	中国宝安	159,400	910,174.00	0.31
64	600699	均胜电子	42,300	903,528.00	0.31
65	601168	西部矿业	141,500	902,770.00	0.31
66	600549	厦门钨业	62,900	900,099.00	0.31
67	002572	索菲亚	48,000	890,880.00	0.31
68	002092	中泰化学	111,400	886,744.00	0.31
69	600572	康恩贝	138,499	886,393.60	0.31
70	600820	隧道股份	139,900	882,769.00	0.30

71	600410	华胜天成	81,723	876,887.79	0.30
72	600673	东阳光	111,700	876,845.00	0.30
73	601005	重庆钢铁	435,100	874,551.00	0.30
74	600909	华安证券	133,000	869,820.00	0.30
75	000060	中金岭南	185,400	869,526.00	0.30
76	600875	东方电气	81,600	866,592.00	0.30
77	600392	盛和资源	78,095	863,730.70	0.30
78	600376	首开股份	95,600	853,708.00	0.29
79	000999	华润三九	29,000	850,860.00	0.29
80	300168	万达信息	65,200	845,644.00	0.29
81	000039	中集集团	78,960	843,292.80	0.29
82	000690	宝新能源	129,151	831,732.44	0.29
83	000960	锡业股份	74,200	828,814.00	0.29
84	000830	鲁西化工	76,107	828,044.16	0.29
85	600718	东软集团	64,500	826,890.00	0.28
86	600166	福田汽车	346,300	820,731.00	0.28
87	002353	杰瑞股份	35,500	820,050.00	0.28
88	600811	东方集团	220,350	819,702.00	0.28
89	600755	厦门国贸	94,302	813,826.26	0.28
90	600022	山东钢铁	487,110	813,473.70	0.28
91	600959	江苏有线	182,800	813,460.00	0.28
92	601333	广深铁路	251,600	812,668.00	0.28
93	002372	伟星新材	46,660	811,884.00	0.28
94	600266	北京城建	100,400	809,224.00	0.28
95	002191	劲嘉股份	65,174	808,809.34	0.28
96	600839	四川长虹	273,900	808,005.00	0.28
97	000581	威孚高科	43,400	805,504.00	0.28
98	600567	山鹰纸业	238,100	802,397.00	0.28
99	601866	中远海发	294,200	800,224.00	0.28
100	600804	鹏博士	106,300	799,376.00	0.28
101	000547	航天发展	83,400	797,304.00	0.27
102	002281	光迅科技	30,069	796,227.12	0.27
103	600885	宏发股份	32,720	795,096.00	0.27
104	002387	维信诺	60,800	793,440.00	0.27
105	002078	太阳纸业	115,326	785,370.06	0.27
106	600521	华海药业	55,700	785,370.00	0.27
107	601872	招商轮船	180,000	784,800.00	0.27
108	603939	益丰药房	11,200	783,888.00	0.27
109	600881	亚泰集团	240,910	782,957.50	0.27
110	600315	上海家化	24,900	775,635.00	0.27
111	002074	国轩高科	59,000	773,490.00	0.27
112	002916	深南电路	7,560	770,515.20	0.27

113	002217	合力泰	138,700	767,011.00	0.26
114	600808	马钢股份	221,400	754,974.00	0.26
115	600486	扬农化工	13,800	754,860.00	0.26
116	603077	和邦生物	393,043	746,781.70	0.26
117	600094	大名城	118,200	743,478.00	0.26
118	300009	安科生物	46,700	742,530.00	0.26
119	002273	水晶光电	64,034	741,513.72	0.26
120	600260	凯乐科技	37,108	741,417.84	0.26
121	600037	歌华有线	72,300	741,075.00	0.26
122	600079	人福医药	70,300	738,150.00	0.25
123	002221	东华能源	85,704	737,911.44	0.25
124	603000	人民网	41,000	731,030.00	0.25
125	600160	巨化股份	101,820	723,940.20	0.25
126	002670	国盛金控	57,401	723,252.60	0.25
127	002038	双鹭药业	30,500	718,580.00	0.25
128	000970	中科三环	63,200	717,320.00	0.25
129	600845	宝信软件	25,090	714,563.20	0.25
130	002002	鸿达兴业	115,177	712,945.63	0.25
131	300027	华谊兄弟	145,100	712,441.00	0.25
132	000983	西山煤电	116,900	708,414.00	0.24
133	002085	万丰奥威	97,300	708,344.00	0.24
134	300274	阳光电源	75,620	707,047.00	0.24
135	300315	掌趣科技	204,500	705,525.00	0.24
136	601699	潞安环能	88,700	704,278.00	0.24
137	600967	内蒙一机	62,701	702,251.20	0.24
138	000513	丽珠集团	21,079	700,455.17	0.24
139	600435	北方导航	77,320	695,106.80	0.24
140	000729	燕京啤酒	104,500	693,880.00	0.24
141	600143	金发科技	141,100	691,390.00	0.24
142	002607	中公教育	50,300	690,619.00	0.24
143	300088	长信科技	136,452	690,447.12	0.24
144	600282	南钢股份	196,900	689,150.00	0.24
145	600737	中粮糖业	79,300	688,324.00	0.24
146	600466	蓝光发展	110,620	688,056.40	0.24
147	600388	龙净环保	55,500	687,645.00	0.24
148	600064	南京高科	64,158	687,132.18	0.24
149	600643	爱建集团	71,278	682,843.24	0.24
150	002589	瑞康医药	89,270	677,559.30	0.23
151	002110	三钢闽光	72,750	676,575.00	0.23
152	000089	深圳机场	76,100	676,529.00	0.23
153	600863	内蒙华电	215,400	676,356.00	0.23
154	300166	东方国信	54,918	674,942.22	0.23

155	600021	上海电力	77,700	674,436.00	0.23
156	600171	上海贝岭	41,502	674,407.50	0.23
157	601098	中南传媒	53,300	673,712.00	0.23
158	603444	吉比特	3,200	671,872.00	0.23
159	000878	云南铜业	63,100	670,753.00	0.23
160	002174	游族网络	39,500	666,760.00	0.23
161	300001	特锐德	37,000	666,740.00	0.23
162	603517	绝味食品	17,000	661,470.00	0.23
163	300207	欣旺达	57,400	661,248.00	0.23
164	002131	利欧股份	345,173	659,280.43	0.23
165	600026	中远海能	101,470	658,540.30	0.23
166	002019	亿帆医药	53,700	657,825.00	0.23
167	002690	美亚光电	20,100	655,260.00	0.23
168	601118	海南橡胶	127,000	654,050.00	0.23
169	000563	陕国投 A	147,030	652,813.20	0.22
170	600258	首旅酒店	36,300	652,674.00	0.22
171	000636	风华高科	53,043	641,820.30	0.22
172	601106	中国一重	203,500	638,990.00	0.22
173	002440	闰土股份	51,200	637,952.00	0.22
174	601718	际华集团	162,900	636,939.00	0.22
175	000883	湖北能源	144,800	628,432.00	0.22
176	002155	湖南黄金	62,400	628,368.00	0.22
177	000826	启迪桑德	53,000	624,870.00	0.22
178	600380	健康元	71,892	621,865.80	0.21
179	002233	塔牌集团	52,981	618,818.08	0.21
180	601100	恒立液压	19,700	618,186.00	0.21
181	000930	中粮生化	82,188	618,053.76	0.21
182	600373	中文传媒	49,200	617,952.00	0.21
183	002152	广电运通	89,300	611,705.00	0.21
184	000559	万向钱潮	102,100	610,558.00	0.21
185	002250	联化科技	54,974	609,661.66	0.21
186	000732	泰禾集团	36,900	608,850.00	0.21
187	600649	城投控股	93,800	606,886.00	0.21
188	300316	晶盛机电	47,700	605,313.00	0.21
189	601966	玲珑轮胎	35,600	605,200.00	0.21
190	000598	兴蓉环境	132,900	604,695.00	0.21
191	601000	唐山港	219,711	604,205.25	0.21
192	000681	视觉中国	31,100	602,718.00	0.21
193	000932	华菱钢铁	125,200	597,204.00	0.21
194	600008	首创股份	168,700	593,824.00	0.20
195	600782	新钢股份	118,200	591,000.00	0.20
196	300182	捷成股份	133,700	589,617.00	0.20

197	600039	四川路桥	160,639	584,725.96	0.20
198	601231	环旭电子	48,500	584,425.00	0.20
199	600827	百联股份	59,500	583,695.00	0.20
200	002399	海普瑞	27,800	583,522.00	0.20
201	600648	外高桥	27,800	583,244.00	0.20
202	600500	中化国际	77,300	577,431.00	0.20
203	600515	海航基础	115,900	573,705.00	0.20
204	002583	海能达	68,100	571,359.00	0.20
205	002004	华邦健康	117,510	571,098.60	0.20
206	000738	航发控制	42,500	569,500.00	0.20
207	600748	上实发展	68,346	566,588.34	0.20
208	600598	北大荒	52,700	565,471.00	0.19
209	601179	中国西电	152,100	562,770.00	0.19
210	000758	中色股份	102,200	561,078.00	0.19
211	000031	大悦城	87,357	560,831.94	0.19
212	000685	中山公用	65,644	560,599.76	0.19
213	002368	太极股份	18,480	559,944.00	0.19
214	002266	浙富控股	117,345	557,388.75	0.19
215	601608	中信重工	128,800	556,416.00	0.19
216	603501	韦尔股份	10,100	554,591.00	0.19
217	300418	昆仑万维	42,700	549,549.00	0.19
218	300058	蓝色光标	127,600	544,852.00	0.19
219	000008	神州高铁	144,400	544,388.00	0.19
220	600729	重庆百货	18,000	544,320.00	0.19
221	000807	云铝股份	116,000	544,040.00	0.19
222	000027	深圳能源	87,500	542,500.00	0.19
223	601678	滨化股份	80,224	542,314.24	0.19
224	000877	天山股份	46,595	541,433.90	0.19
225	600633	浙数文化	57,900	541,365.00	0.19
226	600138	中青旅	42,526	539,654.94	0.19
227	600167	联美控股	50,940	538,945.20	0.19
228	600120	浙江东方	42,202	537,653.48	0.19
229	603228	景旺电子	13,380	535,333.80	0.18
230	002414	高德红外	27,788	533,529.60	0.18
231	000488	晨鸣纸业	99,095	531,149.20	0.18
232	300133	华策影视	78,900	530,997.00	0.18
233	002183	怡亚通	110,200	525,654.00	0.18
234	600507	方大特钢	53,700	525,186.00	0.18
235	600777	新潮能源	252,200	524,576.00	0.18
236	603885	吉祥航空	40,000	524,000.00	0.18
237	000887	中鼎股份	54,400	521,696.00	0.18
238	600511	国药股份	22,686	521,097.42	0.18

239	600409	三友化工	91,894	520,120.04	0.18
240	600155	华创阳安	38,700	519,741.00	0.18
241	600348	阳泉煤业	89,200	518,252.00	0.18
242	600056	中国医药	38,398	517,989.02	0.18
243	002603	以岭药业	44,700	517,626.00	0.18
244	600823	世茂股份	111,300	513,093.00	0.18
245	600216	浙江医药	50,100	513,024.00	0.18
246	600158	中体产业	50,101	512,533.23	0.18
247	002408	齐翔腾达	65,863	510,438.25	0.18
248	000528	柳工	76,600	510,156.00	0.18
249	600418	江淮汽车	98,362	507,547.92	0.17
250	000813	德展健康	66,500	506,730.00	0.17
251	600060	海信电器	58,200	501,684.00	0.17
252	600970	中材国际	77,450	498,003.50	0.17
253	603883	老百姓	8,500	497,080.00	0.17
254	600525	长园集团	78,539	496,366.48	0.17
255	600277	亿利洁能	101,600	494,792.00	0.17
256	000301	东方盛虹	89,600	491,904.00	0.17
257	002812	恩捷股份	10,500	490,875.00	0.17
258	002701	奥瑞金	104,820	489,509.40	0.17
259	601880	大连港	229,499	488,832.87	0.17
260	600597	光明乳业	45,400	488,050.00	0.17
261	600062	华润双鹤	38,640	487,250.40	0.17
262	300113	顺网科技	30,900	484,512.00	0.17
263	600580	卧龙电驱	57,577	484,222.57	0.17
264	300010	立思辰	51,500	483,585.00	0.17
265	002640	跨境通	57,800	481,474.00	0.17
266	601958	金铂股份	71,800	481,060.00	0.17
267	002407	多氟多	40,600	480,704.00	0.17
268	600478	科力远	85,900	480,181.00	0.17
269	000090	天健集团	96,970	479,031.80	0.17
270	002244	滨江集团	115,424	479,009.60	0.17
271	600717	天津港	74,560	478,675.20	0.16
272	002242	九阳股份	22,749	473,406.69	0.16
273	600307	酒钢宏兴	232,300	471,569.00	0.16
274	002212	南洋股份	34,400	471,280.00	0.16
275	300244	迪安诊断	27,600	468,648.00	0.16
276	000156	华数传媒	42,500	467,925.00	0.16
277	000028	国药一致	11,138	465,902.54	0.16
278	600664	哈药股份	112,370	465,211.80	0.16
279	002419	天虹股份	35,600	464,936.00	0.16
280	600312	平高电气	60,400	464,476.00	0.16

281	300002	神州泰岳	116,400	463,272.00	0.16
282	300026	红日药业	134,102	462,651.90	0.16
283	002056	横店东磁	60,864	462,566.40	0.16
284	601200	上海环境	33,940	461,923.40	0.16
285	002128	露天煤业	53,031	458,718.15	0.16
286	002426	胜利精密	178,700	457,472.00	0.16
287	601928	凤凰传媒	56,600	456,762.00	0.16
288	600557	康缘药业	30,734	456,707.24	0.16
289	600316	洪都航空	31,900	456,489.00	0.16
290	002491	通鼎互联	56,200	454,658.00	0.16
291	601611	中国核建	58,400	454,352.00	0.16
292	600759	洲际油气	117,513	453,600.18	0.16
293	603659	璞泰来	9,600	451,392.00	0.16
294	600259	广晟有色	11,200	451,360.00	0.16
295	600073	上海梅林	48,700	448,040.00	0.15
296	002665	首航节能	131,835	446,920.65	0.15
297	002470	金正大	122,100	444,444.00	0.15
298	002030	达安基因	41,408	444,307.84	0.15
299	000021	深科技	54,630	444,141.90	0.15
300	600884	杉杉股份	41,672	443,806.80	0.15
301	300134	大富科技	28,500	442,605.00	0.15
302	601717	郑煤机	77,310	441,440.10	0.15
303	300324	旋极信息	76,232	441,383.28	0.15
304	600754	锦江股份	17,800	438,592.00	0.15
305	300197	铁汉生态	121,800	437,262.00	0.15
306	002064	华峰氨纶	87,100	437,242.00	0.15
307	600125	铁龙物流	67,787	437,226.15	0.15
308	600859	王府井	28,764	436,925.16	0.15
309	002176	江特电机	88,600	431,482.00	0.15
310	600017	日照港	136,880	431,172.00	0.15
311	600267	海正药业	43,000	430,000.00	0.15
312	603816	顾家家居	13,420	428,366.40	0.15
313	000078	海王生物	122,950	427,866.00	0.15
314	000712	锦龙股份	33,300	427,572.00	0.15
315	300115	长盈精密	40,580	425,684.20	0.15
316	600751	海航科技	133,700	425,166.00	0.15
317	600582	天地科技	122,800	423,660.00	0.15
318	600575	皖江物流	144,100	422,213.00	0.15
319	002051	中工国际	36,740	421,407.80	0.15
320	000727	华东科技	201,600	421,344.00	0.15
321	002358	森源电气	41,400	420,210.00	0.14
322	002302	西部建设	37,400	416,636.00	0.14

323	000959	首钢股份	117,700	414,304.00	0.14
324	002424	贵州百灵	41,900	413,972.00	0.14
325	002280	联络互动	113,100	413,946.00	0.14
326	002317	众生药业	48,373	411,654.23	0.14
327	002285	世联行	91,003	410,423.53	0.14
328	600499	科达洁能	93,600	409,968.00	0.14
329	600291	西水股份	40,600	408,436.00	0.14
330	000400	许继电气	44,894	406,739.64	0.14
331	600565	迪马股份	108,500	404,705.00	0.14
332	600901	江苏租赁	66,400	404,376.00	0.14
333	603866	桃李面包	9,700	404,005.00	0.14
334	002505	大康农业	203,470	400,835.90	0.14
335	600563	法拉电子	9,719	400,131.23	0.14
336	000519	中兵红箭	51,627	399,076.71	0.14
337	000158	常山北明	73,510	398,424.20	0.14
338	002444	巨星科技	39,911	398,311.78	0.14
339	600317	营口港	144,000	397,440.00	0.14
340	000717	韶钢松山	89,700	397,371.00	0.14
341	600835	上海机电	23,894	396,640.40	0.14
342	600645	中源协和	22,830	395,187.30	0.14
343	000926	福星股份	57,090	395,062.80	0.14
344	600993	马应龙	22,347	394,424.55	0.14
345	002028	思源电气	39,420	392,623.20	0.14
346	002390	信邦制药	74,200	391,034.00	0.13
347	000718	苏宁环球	112,600	389,596.00	0.13
348	002573	清新环境	48,200	388,010.00	0.13
349	600141	兴发集团	37,720	387,761.60	0.13
350	600770	综艺股份	57,900	386,772.00	0.13
351	600908	无锡银行	68,500	386,340.00	0.13
352	601326	秦港股份	105,900	384,417.00	0.13
353	600151	航天机电	74,455	383,443.25	0.13
354	000006	深振业 A	70,119	382,148.55	0.13
355	002249	大洋电机	87,857	381,299.38	0.13
356	000980	众泰汽车	90,200	379,742.00	0.13
357	000012	南玻 A	90,704	377,328.64	0.13
358	600611	大众交通	81,137	377,287.05	0.13
359	002839	张家港行	67,000	377,210.00	0.13
360	002807	江阴银行	80,480	376,646.40	0.13
361	000543	皖能电力	79,641	375,109.11	0.13
362	002831	裕同科技	19,520	374,198.40	0.13
363	600787	中储股份	65,224	373,733.52	0.13
364	600765	中航重机	40,389	372,790.47	0.13

365	600862	中航高科	41,400	372,186.00	0.13
366	600458	时代新材	35,753	371,473.67	0.13
367	002332	仙琚制药	54,395	367,710.20	0.13
368	300055	万邦达	51,300	365,769.00	0.13
369	603712	七一二	17,100	363,033.00	0.13
370	000848	承德露露	43,559	362,846.47	0.12
371	603515	欧普照明	11,240	362,490.00	0.12
372	002366	台海核电	38,600	361,296.00	0.12
373	601019	山东出版	46,400	360,992.00	0.12
374	300308	中际旭创	10,520	357,574.80	0.12
375	000600	建投能源	53,100	355,770.00	0.12
376	600169	太原重工	133,100	355,377.00	0.12
377	600338	西藏珠峰	20,320	355,193.60	0.12
378	002048	宁波华翔	32,611	352,851.02	0.12
379	600393	粤泰股份	75,200	349,680.00	0.12
380	000564	供销大集	133,600	348,696.00	0.12
381	002431	棕榈股份	88,250	348,587.50	0.12
382	002093	国脉科技	37,391	347,362.39	0.12
383	601311	骆驼股份	31,976	346,939.60	0.12
384	002672	东江环保	30,545	346,380.30	0.12
385	002635	安洁科技	25,650	346,018.50	0.12
386	603233	大参林	7,680	345,600.00	0.12
387	300376	易事特	69,100	340,663.00	0.12
388	300287	飞利信	85,200	338,244.00	0.12
389	300297	蓝盾股份	55,700	335,871.00	0.12
390	002254	泰和新材	31,659	334,952.22	0.12
391	002745	木林森	28,400	332,848.00	0.11
392	002544	杰赛科技	25,500	331,500.00	0.11
393	601689	拓普集团	21,600	330,912.00	0.11
394	600978	宜华生活	88,000	330,880.00	0.11
395	300159	新研股份	66,300	330,174.00	0.11
396	601016	节能风电	123,300	327,978.00	0.11
397	000869	张裕A	10,100	324,412.00	0.11
398	603766	隆鑫通用	76,248	319,479.12	0.11
399	603198	迎驾贡酒	17,800	318,798.00	0.11
400	600623	华谊集团	41,500	317,060.00	0.11
401	300266	兴源环境	69,700	316,438.00	0.11
402	600640	号百控股	23,628	316,142.64	0.11
403	600006	东风汽车	59,300	316,069.00	0.11
404	300199	翰宇药业	34,400	315,448.00	0.11
405	002503	搜于特	114,698	315,419.50	0.11
406	600195	中牧股份	22,326	309,215.10	0.11

407	000062	深圳华强	23,250	308,992.50	0.11
408	002709	天赐材料	12,700	307,340.00	0.11
409	000501	鄂武商 A	28,529	306,686.75	0.11
410	603888	新华网	15,350	306,386.00	0.11
411	600757	长江传媒	44,969	306,238.89	0.11
412	600639	浦东金桥	18,912	305,807.04	0.11
413	000990	诚志股份	18,600	305,226.00	0.11
414	600750	江中药业	23,354	303,835.54	0.10
415	000937	冀中能源	78,600	303,396.00	0.10
416	600329	中新药业	21,155	302,304.95	0.10
417	600694	大商股份	10,800	301,428.00	0.10
418	603056	德邦股份	21,400	301,312.00	0.10
419	600545	卓郎智能	42,195	300,006.45	0.10
420	000426	兴业矿业	55,488	297,970.56	0.10
421	600869	智慧能源	65,872	297,741.44	0.10
422	002382	蓝帆医疗	21,500	297,130.00	0.10
423	600416	湘电股份	49,132	295,774.64	0.10
424	603568	伟明环保	13,742	295,727.84	0.10
425	002375	亚厦股份	49,700	293,727.00	0.10
426	002815	崇达技术	18,600	289,974.00	0.10
427	000537	广宇发展	41,500	287,180.00	0.10
428	603806	福斯特	7,730	283,922.90	0.10
429	601001	大同煤业	62,100	283,797.00	0.10
430	300257	开山股份	25,473	282,240.84	0.10
431	002707	众信旅游	45,900	278,613.00	0.10
432	002920	德赛西威	12,300	275,520.00	0.09
433	000061	农产品	50,400	273,168.00	0.09
434	601127	小康股份	20,800	272,480.00	0.09
435	002434	万里扬	39,800	270,242.00	0.09
436	002489	浙江永强	80,694	269,517.96	0.09
437	600058	五矿发展	31,800	268,710.00	0.09
438	000829	天音控股	46,168	268,697.76	0.09
439	600874	创业环保	32,179	266,763.91	0.09
440	002509	天广中茂	129,400	266,564.00	0.09
441	600707	彩虹股份	53,200	266,532.00	0.09
442	601801	皖新传媒	44,300	266,243.00	0.09
443	603377	东方时尚	17,360	265,260.80	0.09
444	002948	青岛银行	40,800	262,344.00	0.09
445	600657	信达地产	63,510	261,661.20	0.09
446	600971	恒源煤电	44,496	260,301.60	0.09
447	002681	奋达科技	61,214	259,547.36	0.09
448	000536	华映科技	102,600	258,552.00	0.09

449	002437	誉衡药业	65,175	257,441.25	0.09
450	002512	达华智能	56,900	257,188.00	0.09
451	002118	紫鑫药业	38,020	256,254.80	0.09
452	002251	步步高	31,962	254,737.14	0.09
453	002517	恺英网络	79,800	254,562.00	0.09
454	000541	佛山照明	47,989	251,462.36	0.09
455	600996	贵广网络	23,200	250,096.00	0.09
456	300459	金科文化	43,900	249,791.00	0.09
457	600098	广州发展	40,500	249,480.00	0.09
458	000766	通化金马	35,800	243,440.00	0.08
459	601139	深圳燃气	42,700	242,963.00	0.08
460	600350	山东高速	50,000	240,000.00	0.08
461	600428	中远海特	63,743	235,849.10	0.08
462	002936	郑州银行	45,700	232,156.00	0.08
463	000552	靖远煤电	84,820	229,862.20	0.08
464	603328	依顿电子	22,200	227,994.00	0.08
465	601869	长飞光纤	6,000	225,000.00	0.08
466	600335	国机汽车	32,351	223,868.92	0.08
467	600053	九鼎投资	9,600	223,680.00	0.08
468	601615	明阳智能	20,500	222,220.00	0.08
469	002344	海宁皮城	47,600	221,816.00	0.08
470	002482	广田集团	45,565	221,445.90	0.08
471	600903	贵州燃气	16,900	220,207.00	0.08
472	601003	柳钢股份	38,000	220,020.00	0.08
473	002818	富森美	16,780	215,287.40	0.07
474	601777	力帆股份	48,829	209,476.41	0.07
475	000587	金洲慈航	78,734	203,133.72	0.07
476	603556	海兴电力	14,630	202,186.60	0.07
477	600939	重庆建工	40,400	197,556.00	0.07
478	000987	越秀金控	20,400	184,008.00	0.06
479	000025	特力A	8,755	177,026.10	0.06
480	002416	爱施德	27,640	172,750.00	0.06
481	600126	杭钢股份	37,540	171,182.40	0.06
482	601969	海南矿业	29,000	170,520.00	0.06
483	600985	淮北矿业	14,500	164,430.00	0.06
484	002699	美盛文化	27,000	162,000.00	0.06
485	601068	中铝国际	22,800	157,320.00	0.05
486	603225	新凤鸣	12,372	154,526.28	0.05
487	600280	中央商场	42,641	153,081.19	0.05
488	601811	新华文轩	11,800	144,078.00	0.05
489	603486	科沃斯	4,620	139,755.00	0.05
490	002941	新疆交建	5,300	137,800.00	0.05

491	603868	飞科电器	3,500	137,025.00	0.05
492	603355	莱克电气	6,000	129,120.00	0.04
493	000761	本钢板材	28,400	122,120.00	0.04
494	002946	新乳业	7,000	105,980.00	0.04
495	603650	彤程新材	4,800	104,832.00	0.04
496	600917	重庆燃气	13,900	96,744.00	0.03
497	603025	大豪科技	8,153	83,486.72	0.03
498	603569	长久物流	5,860	67,917.40	0.02
499	603877	太平鸟	4,300	66,736.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600968	海油发展	50,833	180,457.15	0.06
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.03
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
4	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
5	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
6	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
7	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
8	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002405	四维图新	2,756,299.99	1.22
2	002157	正邦科技	1,528,031.00	0.67
3	600739	辽宁成大	1,236,590.00	0.55
4	600763	通策医疗	1,162,746.00	0.51
5	002075	沙钢股份	1,125,223.00	0.50
6	000333	美的集团	1,051,358.41	0.46
7	002926	华西证券	1,003,029.00	0.44
8	600745	闻泰科技	990,232.00	0.44
9	600549	厦门钨业	989,103.50	0.44
10	600497	驰宏锌锗	987,268.00	0.44
11	002797	第一创业	954,562.00	0.42
12	002821	凯莱英	919,139.00	0.41
13	002572	索菲亚	882,417.88	0.39
14	600909	华安证券	824,275.00	0.36
15	601333	广深铁路	817,576.42	0.36

16	002387	维信诺	797,074.00	0.35
17	002217	合力泰	797,001.00	0.35
18	300009	安科生物	756,642.00	0.33
19	600521	华海药业	737,238.00	0.33
20	601699	潞安环能	729,340.10	0.32

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	300347	泰格医药	1,740,951.00	0.77
2	002410	广联达	1,534,390.00	0.68
3	000656	金科股份	1,294,933.28	0.57
4	600600	青岛啤酒	1,259,879.37	0.56
5	300146	汤臣倍健	1,232,192.00	0.54
6	600256	广汇能源	1,108,488.10	0.49
7	000418	小天鹅 A	1,051,358.41	0.46
8	000333	美的集团	1,027,880.90	0.45
9	000596	古井贡酒	956,047.86	0.42
10	300413	芒果超媒	885,894.00	0.39
11	603899	晨光文具	852,713.00	0.38
12	002405	四维图新	814,926.00	0.36
13	002013	中航机电	752,406.14	0.33
14	600655	豫园股份	721,099.44	0.32
15	600270	外运发展	586,880.40	0.26
16	000667	美好置业	545,670.00	0.24
17	601598	中国外运	544,069.75	0.24
18	600366	宁波韵升	525,683.46	0.23
19	600503	华丽家族	511,965.00	0.23
20	000969	安泰科技	440,991.04	0.19

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	46,996,106.52
卖出股票收入(成交)总额	46,684,621.25

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

1、正邦科技股份有限公司（以下简称“正邦科技”，股票代码：002157）下属公司肇东正邦养殖有限公司配套的环境保护设施未进行验收擅自进行投产，并且向厂区草地排放养殖废水，排放废水 COD 超过《农田灌溉水质标准》(GB5084-2005)中旱作限制要求。肇东正邦养殖有限公司配套的环境保护污水处理设施未运行，氧化塘防渗膜破损严重，企业向场区北侧草甸排放未经处理的污水。于 2018 年 7 月 20 日收到肇东市环境保护局处罚决定书，责令其自接到决定书之日起 10 日内超标废水抽回氧化塘待处理，90 日内完成环保设施的修复并完成验收；罚款人民币合计壹佰万元整，责令改正违法行为，立即制定环保整改计划。

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正邦科技进行了投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有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

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	1,385.40
2	应收证券清算款	166,720.30
3	应收股利	-
4	应收利息	1,438.62
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	169,544.32

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.01	新股流通受限

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

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
313	672,757.05	2,000,133.00	0.95	2,572,823.00	1.22

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	206,000,000.00	97.83

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国银行股份有限公司—景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	206,000,000	97.83
2	中国证券金融股份有限公司	2,000,000	0.95
3	吴子树	312,000	0.15
4	陆学泉	200,000	0.09
5	杜培新	129,500	0.06
6	孙飞	103,800	0.05
7	沈健美	78,000	0.04
8	邱雨	71,800	0.03
9	柳青	69,400	0.03
10	高伟煊	49,000	0.02
11	蔡志萍	47,900	0.02

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研发部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 12 月 26 日） 基金份额总额	512,572,956.00
本报告期期初基金份额总额	196,572,956.00
本报告期基金总申购份额	14,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	210,572,956.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人无重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

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

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券股份有限公司	2	47,598,305.50	53.74%	44,329.35	53.75%	-
长城证券股份有限公司	3	38,384,100.29	43.34%	35,745.67	43.34%	-
中国银河证券股份有限公司	1	1,481,178.58	1.67%	1,379.45	1.67%	-
招商证券股份有限公司	2	1,101,557.09	1.24%	1,025.91	1.24%	-
海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	本期新增
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准：

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、

个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	53,981.59	100.00%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证券报	2019-01-21
2	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证券报	2019-02-01
3	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证券报	2019-02-01
4	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 1 号更新招募说明书	中国证券报	2019-02-01

5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报	2019-02-23
6	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年年度报告	中国证券报	2019-03-26
7	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年年度报告摘要	中国证券报	2019-03-26
8	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报	2019-04-03
9	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证券报	2019-04-04
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报	2019-04-08
11	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报	2019-04-11
12	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证券报	2019-04-16
13	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证券报	2019-04-20
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报	2019-05-09
15	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证券报	2019-05-13
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报	2019-05-20
17	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报	2019-06-04
18	景顺长城基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报	2019-06-15
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	中国证券报	2019-06-21
20	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证券报	2019-06-25
21	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统中国工商银行渠道暂停服务的公告	中国证券报	2019-06-26

§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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
本基金的联接基金	1	20190101-20190630	192,000,000.00	14,000,000.00	-	206,000,000.00	97.83
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 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日