

# 景顺长城产业趋势混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 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              | 9         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 9         |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 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        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>43</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 43        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 44        |
| 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       | 45        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 48        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 49        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 .....    | 49        |
| 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 ..... | 49        |
| 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 ..... | 49        |
| 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 .....    | 50        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 50        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 50        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 50        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>51</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 51        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 51        |
| 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 .....      | 51        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>52</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>52</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 52        |
| 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 .....      | 52        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 52        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 52        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 52        |
| 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 .....         | 52        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 53        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 59        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>60</b> |
| 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 .....    | 60        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 60        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>60</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 60        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 61        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 61        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 景顺长城产业趋势混合型证券投资基金  |
| 基金简称       | 景顺长城产业趋势混合         |
| 基金主代码      | 010289             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2021 年 1 月 15 日    |
| 基金管理人      | 景顺长城基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 5,810,088,643.75 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。通过精选具有良好持续成长潜力的上市公司，力争实现基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略   | <p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素并结合基金合同、投资制度等要求提出资产配置的建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>1、产业趋势主题的界定</p> <p>产业趋势主题是指在中国加快转变经济发展方式和提高社会生活水平过程中引领或顺应未来发展方向的产业投资机会。</p> <p>2、个股投资策略</p> <p>基金管理人依靠定性研究与定量分析相结合的方法精选个股。</p> <p>3、港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，通过港股通机制投资于香港股票市场。本基金将遵循上述股票投资策略，并结合香港市场特点，选取符合本基金投资目标的优质港股企业。</p> <p>4、本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>（四）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的的证券的久期与收益率的影响。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率*50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*30%+中国债券总指数收益率*20%   |

|        |   |
|--------|---|
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金还可投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> |
|--------|---|

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          | 基金管理人                    | 基金托管人              |
|-------------|--------------------------|--------------------|
| 名称          | 景顺长城基金管理有限公司             | 中国工商银行股份有限公司       |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                       | 杨皞阳                |
|             | 联系电话                     | 0755-82370388      |
|             | 电子邮箱                     | investor@igwfm.com |
| 客户服务电话      | 4008888606               | 95588              |
| 传真          | 0755-22381339            | (010) 66105798     |
| 注册地址        | 深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层 | 北京市西城区复兴门内大街55号    |
| 办公地址        | 深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层 | 北京市西城区复兴门内大街55号    |
| 邮政编码        | 518048                   | 100140             |
| 法定代表人       | 李进                       | 陈四清                |

### 2.4 信息披露方式

|                     |               |
|---------------------|---------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 上海证券报         |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.igwfm.com |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人的办公场所    |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                     |
|--------|--------------|--------------------------|
| 注册登记机构 | 景顺长城基金管理有限公司 | 深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2023年1月1日-2023年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | -145,633,909.00           |
| 本期利润          | -190,772,409.04           |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0317                   |
| 本期加权平均净值利润率   | -4.66%                    |
| 本期基金份额净值增长率   | -4.61%                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023年6月30日)          |
| 期末可供分配利润      | -2,019,441,449.29         |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.3476                   |

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 期末基金资产净值     | 3,822,996,215.13 |
| 期末基金份额净值     | 0.6579           |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率  | -34.21%          |

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

| 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      | 2.59%    | 0.83%       | 2.13%      | 0.79%         | 0.46%   | 0.04% |
| 过去三个月      | -3.28%   | 0.73%       | -3.06%     | 0.72%         | -0.22%  | 0.01% |
| 过去六个月      | -4.61%   | 0.76%       | -0.02%     | 0.73%         | -4.59%  | 0.03% |
| 过去一年       | -14.76%  | 0.89%       | -7.67%     | 0.89%         | -7.09%  | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | -34.21%  | 1.16%       | -19.45%    | 0.96%         | -14.76% | 0.20% |

### 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

景顺长城产业趋势混合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：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于本基金界定的“产业趋势”主题相关的证券资产占非现金资产的比例不低于 80%，本基金投资港股通标的股票的比例占基金股票资产的比例为 0%-50%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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 2021 年 1 月 15 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2023 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 175 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 |        |  |
| 詹成 | 本基金的基金经理 | 2021 年 1 月 15 日 | -    | 12 年   | 通信电子工程博士。曾任英国诺基亚研发中心研究员。2011 年 7 月加入本公司，历任研究部研究员、专户投资部投资经理，自 2015 年 12 月起担任股票投资部基金经理，现任研究部副总经理、股票投资部基金经理。具有 12 年证券、基金行业从业经验。 |

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城产业趋势混合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 17 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

我们的投资策略核心出发点是寻找有能力从小变大，从大变强的企业，在企业不断创造价值的过程中，通过投资这类型企业的股权为基金持有人创造收益，我们坚信权益投资长期获利的根源来自于企业持续稳定的价值创造能力。

但企业成功从小变大，从大变强是一件非常不容易的事情，如果回看中国过去 20 年的商业史，我们观察到并不是所有的行业都能够提供给企业这种长大的机遇，往往顺应中国产业发展趋势，有时代背景推动的那些行业当中的公司，它们成长的速度和成长的确性要远比其他行业更快更强。这也是为什么我们始终坚持从产业发展趋势角度出发来构建投资组合，精选顺应中国未来产业发展趋势的行业和个股，以确定的产业趋势应对万变的市場。

个股选择方面，我们始终坚持三大原则：

##### 1. 寻找赚钱的商业模式。

我们会从生意合伙人的角度出发寻找投资标的，我们心仪的投资标的应该是一门持续稳定给投资人创造真金白银的商业模式，这是成功实现从小变大，从大变强的必要前提。

##### 2. 公司业绩可跟踪可预测性强。

我们会依托景顺长城整体的投研实力从产业链上下游的角度，对上市公司进行全面的研宄，希望尽可能充分的解析公司真实的成长动力，并高频率跟踪产业链上下游的变化，了解公司基本而动态变化。

##### 3. 具有企业家精神的管理团队。

管理层的优劣对公司的价值影响巨大，具有企业家精神的管理团队能够给投资人带来惊喜，能够带领我们选的公司跑的比竞争对手更快。

2023 年上半年，国内经济复苏出现一定波折，内生的顺周期修复尚需要时间，居民就业和收入还在改善过程中，核心通胀较弱，宏观政策保持较强定力，人民币汇率出现一定程度的走弱。

海外方面，美国经济的韧性超出市场预期，虽然欧美在高通胀和货币政策快速紧缩的压力下隐现衰退风险，且以欧美银行业为代表的部分风险点也已有所暴露，但美国经济在服务业的支撑下，就业、消费等数据持续超出市场预期，在很大程度上抵补了货币紧缩的压力，呈现出相当的韧性。半年报报告期内，沪深 300 指数、上证 50 指数、创业板指数分别下跌 0.8%、5.4%和 5.6%；行业方面分化严重，TMT 相关行业涨幅居前，通信（+50.7%）、传媒（+42.8%）、计算机（+27.6%）等行业表现突出，报告期内，本基金依然坚持从产业发展趋势入手，精选顺应中国未来产业发展趋势的行业和个股，以确定的产业趋势应对万变的市場。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年上半年，本基金份额净值增长率为-4.61%，业绩比较基准收益率为-0.02%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们对权益市场相对乐观，我们预计“稳增长”政策有望落地，或可阶段性支撑基建、地产，扭转宏观经济加速下行的悲观预期。同时外部因素也会相对积极，美联储加息进入尾声阶段，中美关系有望阶段性缓和，有利于人民币资产价格回升。阶段性的利空导致市场调整，往往都是加仓的好时机，股票最终都是跟着基本面走的，顺应产业趋势、基本面强劲的公司，在波动完以后，股价还有能力创新高。

短期预测市场的方向不是我们主要的投资策略，特别是在信息传播速度如此之快的互联网时代，市场每天的收盘价可能都是已知信息充分反馈后的公允价格，想基于短期博弈思路寻找市场错误定价的机会可能是难以企及的。反而预测产业的发展趋势是相对容易的，它跟一个国家的资源禀赋、竞争优势和人口结构等中长期的变量相关性较高，更不会随着股票市场每天的涨跌而发生很大幅度的波动。我们依然坚持以确定的产业趋势应对万变的市場的投资策略，通过精选产业发展趋势的受益者，捕获那些能够从小变大，从大变强的优质企业，为持有人创造投资回报。

从中观维度来看，我们组合会持续重点配置两条大的成长赛道，科技创新和消费升级。我们相信在这两个领域中越来越多的中国企业能成长为巨擘，面对未来我们是非常积极乐观的。行业配置上，我们重点看好：

**自主可控和进口替代：**在安全发展的大战略下，产业链安全越来越被重视，能够帮助产业链实现自主可控和进口替代的中小市值公司将比较确定的投资机会。

**军工：**全球面临百年未有之大变局，应对复杂多变的国际形势，需要一个强大的军工产业的支持，在国家加大投入的背景下，很多军工相关企业将会迎来高速成长阶段。

**医药：**医药行业一直受产业政策影响较大，目前估值已经基本合理，我们看好受国内医保政策影响较小，同时受益于国产化率提升和国内需求逐步释放的医疗设备和医疗服务类公司。

消费：国内消费需求的稳健增长是稳经济的重要抓手，在品牌化、品质化、个性化、高端化和便利化的消费趋势引领下，基于庞大的内需市场将诞生一批优质的消费品龙头，我们重点看好受益于国潮崛起的国货品牌公司和受益于提价和高端化的消费品公司。

我们的组合依然会保持一定的均衡性，行业和个股配置会相对分散，尽可能降低基金净值的波动，追求复利，积小胜为大胜，希望我们能够在中长期的维度为持有人创造持续稳定的净值增长。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城产业趋势混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 494,451,735.25         | 582,663,287.69           |
| 结算备付金      |         | 11,997,923.67          | 5,461,369.87             |
| 存出保证金      |         | 1,099,560.49           | 1,037,495.09             |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 3,287,393,626.28       | 3,625,267,124.46         |
| 其中：股票投资    |         | 3,284,708,590.59       | 3,625,267,124.46         |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | 2,685,035.69           | -                        |
| 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         |            | 40,929,746.65             | 68,003,657.31               |
| 应收股利          |            | 440,088.57                | -                           |
| 应收申购款         |            | 51,831.00                 | 177,822.40                  |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                         | -                           |
| 资产总计          |            | 3,836,364,511.91          | 4,282,610,756.82            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2022年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                           |                             |
| 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         |            | 78.08                     | 93.70                       |
| 应付赎回款         |            | 3,368,171.50              | 2,167,797.54                |
| 应付管理人报酬       |            | 4,692,305.50              | 5,422,072.74                |
| 应付托管费         |            | 782,050.93                | 903,678.78                  |
| 应付销售服务费       |            | -                         | -                           |
| 应付投资顾问费       |            | -                         | -                           |
| 应交税费          |            | 11.77                     | -                           |
| 应付利润          |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                         | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 4,525,679.00              | 5,387,970.16                |
| 负债合计          |            | 13,368,296.78             | 13,881,612.92               |
| <b>净资产：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 5,810,088,643.75          | 6,188,766,979.25            |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                         | -                           |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | -1,987,092,428.62         | -1,920,037,835.35           |
| 净资产合计         |            | 3,822,996,215.13          | 4,268,729,143.90            |
| 负债和净资产总计      |            | 3,836,364,511.91          | 4,282,610,756.82            |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.6579 元，基金份额总额 5,810,088,643.75 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城产业趋势混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>         |            | -155,036,556.03                          | -822,680,380.05                               |
| 1. 利息收入                |            | 1,529,204.25                             | 1,223,808.95                                  |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.13   | 1,295,464.73                             | 1,223,808.95                                  |
| 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             |            | 233,739.52                               | -   |
| 证券出借利息收入               |            | -  | -   |
| 其他利息收入                 |            | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -111,447,210.58                          | -983,156,630.67                               |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.14   | -133,584,744.09                          | -1,012,113,737.69                             |
| 基金投资收益                 |            | -  | -   |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.15   | 2,164.42                                 | 3,572,364.28                                  |
| 资产支持证券投资               | 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   | -  | -   |
| 股利收益                   | 6.4.7.19   | 22,135,369.09                            | 25,384,742.74                                 |
| 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   | -45,138,500.04                           | 159,004,746.28                                |
| 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   | 19,950.34                                | 247,695.39                                    |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | 35,735,853.01                            | 43,308,119.10                                 |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 30,506,589.88                            | 36,982,595.42                                 |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 5,084,431.65                             | 6,163,765.95                                  |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | -  | -   |
| 4. 投资顾问费               |            | -  | -   |
| 5. 利息支出                |            | -  | -   |
| 其中：卖出回购金融资产            |            | -  | -   |

|                     |             |                    |                    |
|---------------------|-------------|--------------------|--------------------|
| 支出                  |             |                    |                    |
| 6. 信用减值损失           | 6. 4. 7. 22 | -                  | -                  |
| 7. 税金及附加            |             | 7. 73              | 10. 91             |
| 8. 其他费用             | 6. 4. 7. 23 | 144, 823. 75       | 161, 746. 82       |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) |             | -190, 772, 409. 04 | -865, 988, 499. 15 |
| 减: 所得税费用            |             | -                  | -                  |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列)   |             | -190, 772, 409. 04 | -865, 988, 499. 15 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |             | -                  | -                  |
| 六、综合收益总额            |             | -190, 772, 409. 04 | -865, 988, 499. 15 |

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体: 景顺长城产业趋势混合型证券投资基金

本报告期: 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |        |                       |                      |
|-------------------------------------|---------------------------------------|--------|-----------------------|----------------------|
|                                     | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润                 | 净资产合计                |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                     | 6, 188, 766, 979. 25                  | -      | -1, 920, 037, 835. 35 | 4, 268, 729, 143. 90 |
| 加: 会计政策变更                           | -                                     | -      | -                     | -                    |
| 前期差错更正                              | -                                     | -      | -                     | -                    |
| 其他                                  | -                                     | -      | -                     | -                    |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                     | 6, 188, 766, 979. 25                  | -      | -1, 920, 037, 835. 35 | 4, 268, 729, 143. 90 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | -378, 678, 335. 50                    | -      | -67, 054, 593. 27     | -445, 732, 928. 77   |
| (一)、综合收益总额                          | -                                     | -      | -190, 772, 409. 04    | -190, 772, 409. 04   |
| (二)、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) | -378, 678, 335. 50                    | -      | 123, 717, 815. 77     | -254, 960, 519. 73   |
| 其中: 1. 基金申购款                        | 23, 225, 293. 77                      | -      | -7, 367, 964. 67      | 15, 857, 329. 10     |
| 2. 基金赎回                             | -401, 903, 629. 27                    | -      | 131, 085, 780. 44     | -270, 817, 848. 83   |

|  |                                 |        |                   |                   |
|--|---------------------------------|--------|-------------------|-------------------|
| 回款                                       |                                 |        |                   |                   |
| (三)、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) | -                               | -      | -                 | -                 |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                               | -      | -                 | -                 |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 5,810,088,643.75                | -      | -1,987,092,428.62 | 3,822,996,215.13  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022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(基金净值)                          | 6,851,350,606.57                | -      | -707,143,469.46   | 6,144,207,137.11  |
| 加: 会计政策变更                                | -                               | -      | -                 | -                 |
| 前期差错更正                                   | -                               | -      | -                 | -                 |
| 其他                                       | -                               | -      | -                 | -                 |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                          | 6,851,350,606.57                | -      | -707,143,469.46   | 6,144,207,137.11  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -365,600,639.89                 | -      | -772,463,813.32   | -1,138,064,453.21 |
| (一)、综合收益总额                               | -                               | -      | -865,988,499.15   | -865,988,499.15   |
| (二)、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)      | -365,600,639.89                 | -      | 93,524,685.83     | -272,075,954.06   |
| 其中: 1. 基金申购款                             | 59,144,273.46                   | -      | -14,211,153.01    | 44,933,120.45     |
| 2. 基金赎回款                                 | -424,744,913.35                 | -      | 107,735,838.84    | -317,009,074.51   |
| (三)、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) | -                               | -      | -                 | -                 |

|                  |                  |   |                   |                  |
|------------------|------------------|---|-------------------|------------------|
| 填列)              |                  |   |                   |                  |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | -                | - | -                 | -                |
| 四、本期期末净资产(基金净值)  | 6,485,749,966.68 | - | -1,479,607,282.78 | 5,006,142,683.90 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城产业趋势混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]2197 号文《关于准予景顺长城产业趋势混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城产业趋势混合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 2021 年 1 月 15 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 7,910,596,329.00 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 763.68 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 7,910,597,092.68 元，折合 7,910,597,092.68 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、股指期货、国债期货、股票期权、债券（包括但不限于国债、金融债、地方政府债、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、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具，以及法律法规或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。本基金还可以参与融资业务。

本基金的投资组合比例：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于本基金界定的“产业趋势”主题相关的证券资产占非现金资产的比例不低于 80%，本基金投资港股通标的股票的比例占基金股票资产的比例为 0%-50%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货

货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×30%+中国债券总指数收益率×20%。

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 2023 年 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

(1) 印花税

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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## （2）增值税及附加

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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

### （3）企业所得税

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

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

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

### （4）个人所得税

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

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

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

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

### （5）境外投资

本基金运作过程中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 号文《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 号文《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 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2023年6月30日 |
|----------------|-------------------|
| 活期存款           | 494,451,735.25    |
| 等于：本金          | 494,398,340.94    |
| 加：应计利息         | 53,394.31         |
| 减：坏账准备         | -                 |
| 定期存款           | -                 |
| 等于：本金          | -                 |
| 加：应计利息         | -                 |
| 减：坏账准备         | -                 |
| 其中：存款期限1个月以内   | -                 |
| 存款期限1个月（含）-3个月 | -                 |
| 其他存款           | -                 |
| 等于：本金          | -                 |
| 加：应计利息         | -                 |
| 减：坏账准备         | -                 |
| 合计             | 494,451,735.25    |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023年6月30日 |              |                  |                |            |
|---------------|-------------------|--------------|------------------|----------------|------------|
|               | 成本                | 应计利息         | 公允价值             | 公允价值变动         |            |
| 股票            | 3,295,124,871.73  | -            | 3,284,708,590.59 | -10,416,281.14 |            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                 | -            | -                | -              |            |
| 债券            | 交易所市场             | 1,852,000.00 | 2,228.49         | 2,685,035.69   | 830,807.20 |
|               | 银行间市场             | -            | -                | -              | -          |
|               | 合计                | 1,852,000.00 | 2,228.49         | 2,685,035.69   | 830,807.20 |
| 资产支持证券        | -                 | -            | -                | -              |            |
| 基金            | -                 | -            | -                | -              |            |
| 其他            | -                 | -            | -                | -              |            |
| 合计            | 3,296,976,871.73  | 2,228.49     | 3,287,393,626.28 | -9,585,473.94  |            |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末的买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

### 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

无。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 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<br>2023 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 152.65                 |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 4,402,011.61           |
| 其中：交易所市场    | 4,402,011.61           |
| 银行间市场       | -                      |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 123,514.74             |
| 合计          | 4,525,679.00           |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末          | 6,188,766,979.25                      | 6,188,766,979.25 |
| 本期申购          | 23,225,293.77                         | 23,225,293.77    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -401,903,629.27                       | -401,903,629.27  |
| 本期末           | 5,810,088,643.75                      | 5,810,088,643.75 |

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

| 项目             | 已实现部分             | 未实现部分          | 未分配利润合计           |
|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| 上年度末           | -1,998,145,598.84 | 78,107,763.49  | -1,920,037,835.35 |
| 本期利润           | -145,633,909.00   | -45,138,500.04 | -190,772,409.04   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 124,338,058.55    | -620,242.78    | 123,717,815.77    |
| 其中：基金申购款       | -7,543,997.83     | 176,033.16     | -7,367,964.67     |
| 基金赎回款          | 131,882,056.38    | -796,275.94    | 131,085,780.44    |
| 本期已分配利润        | -                 | -              | -                 |
| 本期末            | -2,019,441,449.29 | 32,349,020.67  | -1,987,092,428.62 |

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入  | 1,205,423.22                    |
| 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 | 81,251.29                       |
| 其他        | 8,790.22                        |
| 合计        | 1,295,464.73                    |

#### 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                   |
|------------------|----------------------|
|                  | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -133,584,744.09      |
| 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               | -133,584,744.09      |

##### 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                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额   | 5,412,772,093.35                |
| 减：卖出股票成本总额 | 5,529,450,801.44                |
| 减：交易费用     | 16,906,036.00                   |
| 买卖股票差价收入   | -133,584,744.09                 |

##### 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                   |
|------------------------------|----------------------|
|                              | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 2,164.42             |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -                    |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                    |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                    |

|    |          |
|----|----------|
| 合计 | 2,164.42 |
|----|----------|

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 22,135,369.09              |
| 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            | 22,135,369.09              |

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -45,138,500.04             |
| 股票投资       | -45,969,307.24             |
| 债券投资       | 830,807.20                 |

|                        |                |
|------------------------|----------------|
| 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                     | -45,138,500.04 |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 18,984.27                       |
| 基金转换费收入 | 966.07                          |
| 合计      | 19,950.34                       |

#### 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                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 审计费用      | 59,507.37                       |
| 信息披露费     | 59,507.37                       |
| 证券出借违约金   | -                               |
| 债券托管账户维护费 | 9,000.00                        |
| 银行划款手续费   | 1,048.00                        |
| 证券组合费     | 15,761.01                       |
| 合计        | 144,823.75                      |

#### 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，本基金无需作披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系           |
|------------------------|-------------------|
| 景顺长城基金管理有限公司           | 基金管理人、登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 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：以下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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                         |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例（%） | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例（%） |
| 长城证券  | 110,905,062.21             | 1.05                    | 427,425,358.83                  | 3.59                    |

## 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<br>2023年1月1日至2023年6月30日      |                   |              |                     |
|-------|---------------------------------|-------------------|--------------|---------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 长城证券  | 98,516.32                       | 1.01              | 98,516.32    | 2.24                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                   |              |                     |
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 长城证券  | 396,304.34                      | 3.63              | 396,304.34   | 6.79                |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 30,506,589.88                            | 36,982,595.42                                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 13,739,991.24                            | 17,076,080.32                                 |

注：基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,084,431.65                             | 6,163,765.95                                  |

注：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未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

本基金本报告期及上年度可比期间未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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |              |
|-----------|----------------------------|--------------|---------------------------------|--------------|
|           | 期末余额                       | 当期利息收入       | 期末余额                            | 当期利息收入       |
| 中国工商银行-活期 | 494,451,735.25             | 1,205,423.22 | 449,132,054.91                  | 1,102,895.54 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行间同业利率计息。

## 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（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |     |        |       |        |          |           |           |    |
|----------------------|------|------------|-----|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 001286               | 陕西能源 | 2023年3月31日 | 6个月 | 新股流通受限 | 9.60  | 9.41   | 3,767    | 36,163.20 | 35,447.47 | -  |
| 001287               | 中电港  | 2023年3月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.88 | 21.02  | 1,386    | 16,465.68 | 29,133.72 | -  |
| 001324               | 长青科技 | 2023年5月12日 | 6个月 | 新股流通受限 | 18.88 | 19.60  | 114      | 2,152.32  | 2,234.40  | -  |

|        |      |            |         |        |       |       |       |            |            |   |
|--------|------|------------|---------|--------|-------|-------|-------|------------|------------|---|
| 001328 | 登康口腔 | 2023年3月29日 | 6个月     | 新股流通受限 | 20.68 | 25.49 | 145   | 2,998.60   | 3,696.05   | - |
| 001360 | 南矿集团 | 2023年3月31日 | 6个月     | 新股流通受限 | 15.38 | 14.87 | 177   | 2,722.26   | 2,631.99   | - |
| 001367 | 海森药业 | 2023年3月30日 | 6个月     | 新股流通受限 | 44.48 | 39.48 | 55    | 2,446.40   | 2,171.40   | - |
| 001380 | 华纬科技 | 2023年5月9日  | 6个月     | 新股流通受限 | 28.84 | 30.78 | 170   | 4,902.80   | 5,232.60   | - |
| 301141 | 中科磁业 | 2023年3月27日 | 6个月     | 新股流通受限 | 41.20 | 42.69 | 262   | 10,794.40  | 11,184.78  | - |
| 301157 | 华塑科技 | 2023年3月1日  | 6个月     | 新股流通受限 | 56.50 | 52.93 | 150   | 8,475.00   | 7,939.50   | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023年6月28日 | 1个月内(含) | 新股流通受限 | 25.82 | 25.82 | 2,754 | 71,108.28  | 71,108.28  | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023年6月28日 | 6个月     | 新股流通受限 | 25.82 | 25.82 | 306   | 7,900.92   | 7,900.92   | - |
| 301203 | 国泰环保 | 2023年3月28日 | 6个月     | 新股流通受限 | 46.13 | 34.40 | 225   | 10,379.25  | 7,740.00   | - |
| 301232 | 飞沃科技 | 2023年6月8日  | 6个月     | 新股流通受限 | 72.50 | 58.42 | 165   | 11,962.50  | 9,639.30   | - |
| 301246 | 宏源药业 | 2023年3月10日 | 6个月     | 新股流通受限 | 50.00 | 30.71 | 931   | 46,550.00  | 28,591.01  | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023年6月29日 | 1个月内(含) | 新股流通受限 | 36.90 | 36.90 | 1,775 | 65,497.50  | 65,497.50  | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023年6月29日 | 6个月     | 新股流通受限 | 36.90 | 36.90 | 198   | 7,306.20   | 7,306.20   | - |
| 301292 | 海科新源 | 2023年6月29日 | 1个月内(含) | 新股流通受限 | 19.99 | 19.99 | 5,241 | 104,767.59 | 104,767.59 | - |
| 301292 | 海科新源 | 2023年6月    | 6个月     | 新股流通   | 19.99 | 19.99 | 583   | 11,654.17  | 11,654.17  | - |

|        |      |                  |           |        |        |        |       |           |           |     |
|--------|------|------------------|-----------|--------|--------|--------|-------|-----------|-----------|-----|
|        |      | 29 日             |           | 受限     |        |        |       |           |           |     |
| 301293 | 三博脑科 | 2023 年 4 月 25 日  | 6 个月      | 新股流通受限 | 29.60  | 71.42  | 333   | 9,856.80  | 23,782.86 | -   |
| 301301 | 川宁生物 | 2022 年 12 月 20 日 | 6 个月以上    | 新股流通受限 | 5.00   | 8.96   | 3,574 | 17,870.00 | 32,023.04 | -   |
| 301307 | 美利信  | 2023 年 4 月 14 日  | 6 个月      | 新股流通受限 | 32.34  | 31.86  | 687   | 22,217.58 | 21,887.82 | -   |
| 301315 | 威士顿  | 2023 年 6 月 13 日  | 6 个月      | 新股流通受限 | 32.29  | 51.12  | 226   | 7,297.54  | 11,553.12 | -   |
| 301317 | 鑫磊股份 | 2023 年 1 月 12 日  | 6 个月      | 新股流通受限 | 20.67  | 26.17  | 694   | 14,344.98 | 18,161.98 | -   |
| 301320 | 豪江智能 | 2023 年 6 月 1 日   | 6 个月      | 新股流通受限 | 13.06  | 20.62  | 642   | 8,384.52  | 13,238.04 | -   |
| 301322 | 绿通科技 | 2023 年 2 月 27 日  | 6 个月      | 新股流通受限 | 131.11 | 53.24  | 261   | 34,219.71 | 13,895.64 | -   |
| 301322 | 绿通科技 | 2023 年 5 月 25 日  | 1-6 个月(含) | 新股流通受限 | -      | 53.24  | 130   | -         | 6,921.20  | 转增股 |
| 301323 | 新莱福  | 2023 年 5 月 29 日  | 6 个月      | 新股流通受限 | 39.06  | 39.36  | 228   | 8,905.68  | 8,974.08  | -   |
| 301325 | 曼恩斯特 | 2023 年 5 月 4 日   | 6 个月      | 新股流通受限 | 76.80  | 107.95 | 364   | 27,955.20 | 39,293.80 | -   |
| 301332 | 德尔玛  | 2023 年 5 月 9 日   | 6 个月      | 新股流通受限 | 14.81  | 13.73  | 1,122 | 16,616.82 | 15,405.06 | -   |
| 301337 | 亚华电子 | 2023 年 5 月 16 日  | 6 个月      | 新股流通受限 | 32.60  | 30.37  | 232   | 7,563.20  | 7,045.84  | -   |
| 301345 | 涛涛车业 | 2023 年 3 月 10 日  | 6 个月      | 新股流通受限 | 73.45  | 46.64  | 266   | 19,537.70 | 12,406.24 | -   |
| 301355 | 南王科技 | 2023 年 6 月 2 日   | 6 个月      | 新股流通受限 | 17.55  | 16.75  | 563   | 9,880.65  | 9,430.25  | -   |

|        |      |            |         |        |       |       |       |            |            |   |
|--------|------|------------|---------|--------|-------|-------|-------|------------|------------|---|
| 301357 | 北方长龙 | 2023年4月11日 | 6个月     | 新股流通受限 | 50.00 | 48.39 | 190   | 9,500.00   | 9,194.10   | - |
| 301358 | 湖南裕能 | 2023年2月1日  | 6个月     | 新股流通受限 | 23.77 | 42.89 | 2,023 | 48,086.71  | 86,766.47  | - |
| 301360 | 荣旗科技 | 2023年4月17日 | 6个月     | 新股流通受限 | 71.88 | 92.60 | 134   | 9,631.92   | 12,408.40  | - |
| 301373 | 凌玮科技 | 2023年1月20日 | 6个月     | 新股流通受限 | 33.73 | 31.85 | 277   | 9,343.21   | 8,822.45   | - |
| 301386 | 未来电器 | 2023年3月21日 | 6个月     | 新股流通受限 | 29.99 | 23.79 | 378   | 11,336.22  | 8,992.62   | - |
| 301397 | 溯联股份 | 2023年6月15日 | 6个月     | 新股流通受限 | 53.27 | 40.20 | 362   | 19,283.74  | 14,552.40  | - |
| 301408 | 华人健康 | 2023年2月22日 | 6个月     | 新股流通受限 | 16.24 | 16.95 | 879   | 14,274.96  | 14,899.05  | - |
| 301419 | 阿莱德  | 2023年2月2日  | 6个月     | 新股流通受限 | 24.80 | 43.85 | 330   | 8,184.00   | 14,470.50  | - |
| 301428 | 世纪恒通 | 2023年5月10日 | 6个月     | 新股流通受限 | 26.35 | 30.60 | 229   | 6,034.15   | 7,007.40   | - |
| 301439 | 泓淋电力 | 2023年3月10日 | 6个月     | 新股流通受限 | 19.99 | 16.90 | 949   | 18,970.51  | 16,038.10  | - |
| 301486 | 致尚科技 | 2023年6月30日 | 1个月内(含) | 新股流通受限 | 57.66 | 57.66 | 4,338 | 250,129.08 | 250,129.08 | - |
| 301486 | 致尚科技 | 2023年6月30日 | 6个月     | 新股流通受限 | 57.66 | 57.66 | 482   | 27,792.12  | 27,792.12  | - |
| 601061 | 中信金属 | 2023年3月30日 | 6个月     | 新股流通受限 | 6.58  | 7.58  | 4,016 | 26,425.28  | 30,441.28  | - |
| 601065 | 江盐集团 | 2023年3月31日 | 6个月     | 新股流通受限 | 10.36 | 11.84 | 875   | 9,065.00   | 10,360.00  | - |
| 601133 | 柏诚股份 | 2023年3月    | 6个月     | 新股流通   | 11.66 | 12.26 | 664   | 7,742.24   | 8,140.64   | - |

|        |      |                 |      |          |        |        |         |               |               |   |
|--------|------|-----------------|------|----------|--------|--------|---------|---------------|---------------|---|
|        |      | 31 日            |      | 受限       |        |        |         |               |               |   |
| 603125 | 常青科技 | 2023 年 3 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通受限   | 25.98  | 24.53  | 160     | 4,156.80      | 3,924.80      | - |
| 603135 | 中重科技 | 2023 年 3 月 29 日 | 6 个月 | 新股流通受限   | 17.80  | 17.89  | 628     | 11,178.40     | 11,234.92     | - |
| 603137 | 恒尚节能 | 2023 年 4 月 10 日 | 6 个月 | 新股流通受限   | 15.90  | 17.09  | 139     | 2,210.10      | 2,375.51      | - |
| 688019 | 安集科技 | 2023 年 6 月 27 日 | 6 个月 | 询价转让流通受限 | 156.68 | 151.00 | 180,000 | 28,202,400.00 | 27,180,000.00 | - |
| 688146 | 中船特气 | 2023 年 4 月 13 日 | 6 个月 | 新股流通受限   | 36.15  | 38.13  | 1,011   | 36,547.65     | 38,549.43     | - |
| 688249 | 晶合集成 | 2023 年 4 月 24 日 | 6 个月 | 新股流通受限   | 19.86  | 18.06  | 7,405   | 147,063.30    | 133,734.30    | - |
| 688334 | 西高院  | 2023 年 6 月 9 日  | 6 个月 | 新股流通受限   | 14.16  | 16.21  | 888     | 12,574.08     | 14,394.48     | - |
| 688352 | 颀中科技 | 2023 年 4 月 11 日 | 6 个月 | 新股流通受限   | 12.10  | 12.07  | 2,361   | 28,568.10     | 28,497.27     | - |
| 688361 | 中科飞测 | 2023 年 5 月 12 日 | 6 个月 | 新股流通受限   | 23.60  | 64.67  | 831     | 19,611.60     | 53,740.77     | - |
| 688429 | 时创能源 | 2023 年 6 月 20 日 | 6 个月 | 新股流通受限   | 19.20  | 25.53  | 346     | 6,643.20      | 8,833.38      | - |
| 688433 | 华曙高科 | 2023 年 4 月 7 日  | 6 个月 | 新股流通受限   | 26.66  | 31.50  | 418     | 11,143.88     | 13,167.00     | - |
| 688443 | 智翔金泰 | 2023 年 6 月 13 日 | 6 个月 | 新股流通受限   | 37.88  | 29.49  | 3,033   | 114,890.04    | 89,443.17     | - |
| 688458 | 美芯晟  | 2023 年 5 月 15 日 | 6 个月 | 新股流通受限   | 75.00  | 90.76  | 221     | 16,575.00     | 20,057.96     | - |
| 688469 | 中芯集成 | 2023 年 4 月 28 日 | 6 个月 | 新股流通受限   | 5.69   | 5.41   | 13,800  | 78,522.00     | 74,658.00     | - |

|        |      |            |         |        |        |        |       |           |            |   |
|--------|------|------------|---------|--------|--------|--------|-------|-----------|------------|---|
| 688472 | 阿特斯  | 2023年6月2日  | 6个月     | 新股流通受限 | 11.10  | 17.04  | 6,261 | 69,497.10 | 106,687.44 | - |
| 688478 | 晶升股份 | 2023年4月13日 | 6个月     | 新股流通受限 | 32.52  | 42.37  | 402   | 13,073.04 | 17,032.74  | - |
| 688479 | 友车科技 | 2023年5月4日  | 6个月     | 新股流通受限 | 33.99  | 29.49  | 332   | 11,284.68 | 9,790.68   | - |
| 688531 | 日联科技 | 2023年3月24日 | 6个月     | 新股流通受限 | 152.38 | 135.97 | 346   | 52,723.48 | 47,045.62  | - |
| 688535 | 华海诚科 | 2023年3月28日 | 6个月     | 新股流通受限 | 35.00  | 51.23  | 161   | 5,635.00  | 8,248.03   | - |
| 688543 | 国科军工 | 2023年6月14日 | 6个月     | 新股流通受限 | 43.67  | 53.05  | 410   | 17,904.70 | 21,750.50  | - |
| 688562 | 航天软件 | 2023年5月15日 | 6个月     | 新股流通受限 | 12.68  | 22.31  | 726   | 9,205.68  | 16,197.06  | - |
| 688576 | 西山科技 | 2023年5月30日 | 6个月     | 新股流通受限 | 135.80 | 120.41 | 240   | 32,592.00 | 28,898.40  | - |
| 688582 | 芯动联科 | 2023年6月21日 | 6个月     | 新股流通受限 | 26.74  | 40.68  | 648   | 17,327.52 | 26,360.64  | - |
| 688593 | 新相微  | 2023年5月25日 | 6个月     | 新股流通受限 | 11.18  | 14.59  | 959   | 10,721.62 | 13,991.81  | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023年6月30日 | 1个月内(含) | 新股流通受限 | 55.00  | 55.00  | 1,251 | 68,805.00 | 68,805.00  | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023年6月30日 | 6个月     | 新股流通受限 | 55.00  | 55.00  | 140   | 7,700.00  | 7,700.00   | - |
| 688620 | 安凯微  | 2023年6月15日 | 6个月     | 新股流通受限 | 10.68  | 12.34  | 1,016 | 10,850.88 | 12,537.44  | - |
| 688623 | 双元科技 | 2023年5月31日 | 6个月     | 新股流通受限 | 125.88 | 86.79  | 178   | 22,406.64 | 15,448.62  | - |
| 688629 | 华丰科技 | 2023年6月    | 6个月     | 新股流通   | 9.26   | 18.59  | 708   | 6,556.08  | 13,161.72  | - |

|        |      |                 |      |        |       |       |     |          |           |   |
|--------|------|-----------------|------|--------|-------|-------|-----|----------|-----------|---|
|        |      | 16 日            |      | 受限     |       |       |     |          |           |   |
| 688631 | 莱斯信息 | 2023 年 6 月 19 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 25.28 | 29.87 | 336 | 8,494.08 | 10,036.32 | - |

#### 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 |
|--------|------|-----------------|--------|--------|-----------------|--------|-----------|---------------|---------------|----|
| 000561 | 烽火电子 | 2023 年 6 月 30 日 | 重大事项停牌 | 11.57  | 2023 年 7 月 14 日 | 12.73  | 1,838,100 | 16,800,260.21 | 21,266,817.00 | -  |

#### 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 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

#### 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 0.07%（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<br>2023年6月<br>30日   | 1个月以内          | 1-3<br>个月 | 3个月<br>-1年 | 1-5<br>年 | 5年以上         | 不计息              | 合计               |
|-------------------------|----------------|-----------|------------|----------|--------------|------------------|------------------|
| 资产                      |                |           |            |          |              |                  |                  |
| 银行存款                    | 494,451,735.25 | -         | -          | -        | -            | -                | 494,451,735.25   |
| 结算备付金                   | 11,997,923.67  | -         | -          | -        | -            | -                | 11,997,923.67    |
| 存出保证金                   | 1,099,560.49   | -         | -          | -        | -            | -                | 1,099,560.49     |
| 交易性金融<br>资产             | -              | -         | -          | -        | 2,685,035.69 | 3,284,708,590.59 | 3,287,393,626.28 |
| 应收股利                    | -              | -         | -          | -        | -            | 440,088.57       | 440,088.57       |
| 应收申购款                   | -              | -         | -          | -        | -            | 51,831.00        | 51,831.00        |
| 应收证券清<br>算款             | -              | -         | -          | -        | -            | 40,929,746.65    | 40,929,746.65    |
| 资产总计                    | 507,549,219.41 | -         | -          | -        | 2,685,035.69 | 3,326,130,256.81 | 3,836,364,511.91 |
| 负债                      |                |           |            |          |              |                  |                  |
| 应付赎回款                   | -              | -         | -          | -        | -            | 3,368,171.50     | 3,368,171.50     |
| 应付管理人<br>报酬             | -              | -         | -          | -        | -            | 4,692,305.50     | 4,692,305.50     |
| 应付托管费                   | -              | -         | -          | -        | -            | 782,050.93       | 782,050.93       |
| 应付证券清<br>算款             | -              | -         | -          | -        | -            | 78.08            | 78.08            |
| 应交税费                    | -              | -         | -          | -        | -            | 11.77            | 11.77            |
| 其他负债                    | -              | -         | -          | -        | -            | 4,525,679.00     | 4,525,679.00     |
| 负债总计                    | -              | -         | -          | -        | -            | 13,368,296.78    | 13,368,296.78    |
| 利率敏感度<br>缺口             | 507,549,219.41 | -         | -          | -        | 2,685,035.69 | -                | -                |
| 上年度末<br>2022年12<br>月31日 | 1个月以内          | 1-3<br>个月 | 3个月<br>-1年 | 1-5<br>年 | 5年以上         | 不计息              | 合计               |
| 资产                      |                |           |            |          |              |                  |                  |
| 银行存款                    | 582,663,287.69 | -         | -          | -        | -            | -                | 582,663,287.69   |
| 结算备付金                   | 5,461,369.87   | -         | -          | -        | -            | -                | 5,461,369.87     |
| 存出保证金                   | 1,037,495.09   | -         | -          | -        | -            | -                | 1,037,495.09     |
| 交易性金融<br>资产             | -              | -         | -          | -        | -            | 3,625,267,124.46 | 3,625,267,124.46 |
| 应收申购款                   | -              | -         | -          | -        | -            | 177,822.40       | 177,822.40       |
| 应收证券清<br>算款             | -              | -         | -          | -        | -            | 68,003,657.31    | 68,003,657.31    |
| 资产总计                    | 589,162,152.65 | -         | -          | -        | -            | 3,693,448,604.17 | 4,282,610,756.82 |
| 负债                      |                |           |            |          |              |                  |                  |
| 应付赎回款                   | -              | -         | -          | -        | -            | 2,167,797.54     | 2,167,797.54     |
| 应付管理人                   | -              | -         | -          | -        | -            | 5,422,072.74     | 5,422,072.74     |

|         |                |   |   |   |   |               |               |
|---------|----------------|---|---|---|---|---------------|---------------|
| 报酬      |                |   |   |   |   |               |               |
| 应付托管费   | -              | - | - | - | - | 903,678.78    | 903,678.78    |
| 应付证券清算款 | -              | - | - | - | - | 93.70         | 93.70         |
| 其他负债    | -              | - | - | - | - | 5,387,970.16  | 5,387,970.16  |
| 负债总计    | -              | - | - | - | - | 13,881,612.92 | 13,881,612.92 |
| 利率敏感度缺口 | 589,162,152.65 | - | - | - | - | -             | -             |

#### 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 0.07%（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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2023年6月30日   |                |                |                |
|-------------------|---------------------|----------------|----------------|----------------|
|                   | 美元<br>折合人民币<br>元    | 港币<br>折合人民币元   | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计             |
| 以外币计价的资产          |                     |                |                |                |
| 交易性金融资产           | -                   | 348,967,489.23 | -              | 348,967,489.23 |
| 资产合计              | -                   | 348,967,489.23 | -              | 348,967,489.23 |
| 以外币计价的负债          |                     |                |                |                |
| 负债合计              | -                   | -              | -              | -              |
| 资产负债表外汇<br>风险敞口净额 | -                   | 348,967,489.23 | -              | 348,967,489.23 |
| 项目                | 上年度末<br>2022年12月31日 |                |                |                |
|                   | 美元<br>折合人民币<br>元    | 港币<br>折合人民币元   | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计             |
| 以外币计价的资产          |                     |                |                |                |

|               |   |                |   |                |
|---------------|---|----------------|---|----------------|
| 交易性金融资产       | - | 416,151,562.77 | - | 416,151,562.77 |
| 资产合计          | - | 416,151,562.77 | - | 416,151,562.77 |
| 以外币计价的负债      |   |                |   |                |
| 负债合计          | - | -              | - | -              |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 416,151,562.77 | - | 416,151,562.77 |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率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（2023年6月30日）             | 上年度末（2022年12月31日） |
|    | 所有外币相对人民币升值5%   | 17,448,374.46               | 20,807,578.14     |
|    | 所有外币相对人民币贬值5%   | -17,448,374.46              | -20,807,578.14    |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2023年6月30日 |              | 上年度末<br>2022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 | 3,284,708,590.59  | 85.92        | 3,625,267,124.46    | 84.93        |
| 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            | 3,284,708,590.59 | 85.92 | 3,625,267,124.46 | 84.93 |

#### 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（2023 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|    | 沪深 300 指数上升 5%          | 152,322,379.92              | 149,827,876.48         |
|    | 沪深 300 指数下降 5%          | -152,322,379.92             | -149,827,876.48        |

#### 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<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 3,236,862,595.81       | 3,590,812,745.77         |
| 第二层次          | 21,921,500.90          | -                        |
| 第三层次          | 28,609,529.57          | 34,454,378.69            |
| 合计            | 3,287,393,626.28       | 3,625,267,124.46         |

**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**

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

**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              | 3,284,708,590.59 | 85.62         |
|    | 其中：股票             | 3,284,708,590.59 | 85.62         |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 2,685,035.69     | 0.07          |
|    | 其中：债券             | 2,685,035.69     | 0.07          |
|    | 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      | 506,449,658.92   | 13.20         |
| 8  | 其他各项资产            | 42,521,226.71    | 1.11          |
| 9  | 合计                | 3,836,364,511.91 | 100.00        |

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 348,967,489.23 元，占基金资产净值的比例为 9.13%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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         | 43,017,297.90    | 1.13         |
| B  | 采矿业              | -                | -            |
| C  | 制造业              | 2,423,133,000.54 | 63.38        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 35,447.47        | 0.00         |
| E  | 建筑业              | 10,516.15        | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 32,728,262.11    | 0.86         |
| 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  | 127,791,098.63   | 3.34         |
| J  | 金融业              | 60,699,464.00    | 1.59         |
| 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       | 25,579,066.49    | 0.67         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 7,740.00         | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | -                | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 215,992,160.07   | 5.65         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 6,747,048.00     | 0.18         |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 2,935,741,101.36 | 76.79        |

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|----------------|--------------|
| 原材料     | -              | -            |
| 周期性消费品  | 19,354,167.28  | 0.51         |
| 非周期性消费品 | 64,495,382.19  | 1.69         |
| 综合      | -              | -            |
| 能源      | -              | -            |
| 金融      | -              | -            |
| 基金      | -              | -            |
| 工业      | -              | -            |
| 信息科技    | -              | -            |
| 公用事业    | -              | -            |
| 通讯      | 265,117,939.76 | 6.93         |
| 合计      | 348,967,489.23 | 9.13         |

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

## 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

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  | 002044 | 美年健康 | 27,485,911 | 195,424,827.21 | 5.11         |
| 2  | 00700  | 腾讯控股 | 623,600    | 190,652,335.00 | 4.99         |
| 3  | 000568 | 泸州老窖 | 765,648    | 160,456,851.36 | 4.20         |
| 4  | 300750 | 宁德时代 | 653,608    | 149,538,974.32 | 3.91         |
| 5  | 002409 | 雅克科技 | 1,811,940  | 132,054,187.20 | 3.45         |
| 6  | 300627 | 华测导航 | 3,976,639  | 129,121,468.33 | 3.38         |
| 7  | 688019 | 安集科技 | 724,746    | 116,970,483.18 | 3.06         |
| 8  | 300037 | 新宙邦  | 1,997,486  | 103,649,548.54 | 2.71         |
| 9  | 002439 | 启明星辰 | 2,900,700  | 86,324,832.00  | 2.26         |
| 10 | 600685 | 中船防务 | 2,744,102  | 82,185,854.90  | 2.15         |
| 11 | 688012 | 中微公司 | 502,635    | 78,637,245.75  | 2.06         |
| 12 | 000733 | 振华科技 | 819,800    | 78,577,830.00  | 2.06         |
| 13 | 603369 | 今世缘  | 1,456,700  | 76,913,760.00  | 2.01         |
| 14 | 000596 | 古井贡酒 | 310,518    | 76,815,942.84  | 2.01         |
| 15 | 688120 | 华海清科 | 302,401    | 76,220,172.05  | 1.99         |
| 16 | 00941  | 中国移动 | 1,261,000  | 74,465,604.76  | 1.95         |
| 17 | 002179 | 中航光电 | 1,625,491  | 73,716,016.85  | 1.93         |
| 18 | 300633 | 开立医疗 | 1,347,674  | 73,448,233.00  | 1.92         |
| 19 | 301039 | 中集车辆 | 4,748,600  | 62,823,978.00  | 1.64         |
| 20 | 300033 | 同花顺  | 346,300    | 60,699,464.00  | 1.59         |
| 21 | 600416 | 湘电股份 | 3,173,700  | 60,585,933.00  | 1.58         |
| 22 | 603596 | 伯特利  | 724,074    | 57,390,105.24  | 1.50         |
| 23 | 688276 | 百克生物 | 865,016    | 54,150,001.60  | 1.42         |
| 24 | 600600 | 青岛啤酒 | 521,300    | 54,022,319.00  | 1.41         |
| 25 | 600566 | 济川药业 | 1,850,300  | 53,732,712.00  | 1.41         |
| 26 | 002254 | 泰和新材 | 2,194,174  | 53,691,437.78  | 1.40         |
| 27 | 000333 | 美的集团 | 867,500    | 51,113,100.00  | 1.34         |
| 28 | 603899 | 晨光股份 | 1,099,328  | 49,074,001.92  | 1.28         |
| 29 | 002271 | 东方雨虹 | 1,786,646  | 48,703,969.96  | 1.27         |
| 30 | 603129 | 春风动力 | 290,979    | 47,109,500.10  | 1.23         |
| 31 | 00291  | 华润啤酒 | 982,000    | 46,717,832.98  | 1.22         |
| 32 | 688002 | 睿创微纳 | 1,013,688  | 45,413,222.40  | 1.19         |
| 33 | 603477 | 巨星农牧 | 1,289,874  | 43,017,297.90  | 1.13         |
| 34 | 603737 | 三棵树  | 651,220    | 42,602,812.40  | 1.11         |
| 35 | 002371 | 北方华创 | 132,900    | 42,215,685.00  | 1.10         |
| 36 | 688037 | 芯源微  | 239,778    | 40,990,049.10  | 1.07         |
| 37 | 603486 | 科沃斯  | 482,000    | 37,485,140.00  | 0.98         |
| 38 | 600998 | 九州通  | 3,145,837  | 32,653,788.06  | 0.85         |
| 39 | 600809 | 山西汾酒 | 151,630    | 28,062,164.10  | 0.73         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 40 | 002536 | 飞龙股份 | 1,696,800 | 25,452,000.00 | 0.67 |
| 41 | 300938 | 信测标准 | 579,870   | 25,398,306.00 | 0.66 |
| 42 | 688521 | 芯原股份 | 317,262   | 22,817,483.04 | 0.60 |
| 43 | 688072 | 拓荆科技 | 53,335    | 22,719,109.95 | 0.59 |
| 44 | 688425 | 铁建重工 | 4,605,990 | 22,154,811.90 | 0.58 |
| 45 | 600066 | 宇通客车 | 1,480,300 | 21,819,622.00 | 0.57 |
| 46 | 000561 | 烽火电子 | 1,838,100 | 21,266,817.00 | 0.56 |
| 47 | 603882 | 金城医学 | 272,100   | 20,543,550.00 | 0.54 |
| 48 | 002444 | 巨星科技 | 916,200   | 20,046,456.00 | 0.52 |
| 49 | 600702 | 舍得酒业 | 157,000   | 19,460,150.00 | 0.51 |
| 50 | 01585  | 雅迪控股 | 1,178,000 | 19,354,167.28 | 0.51 |
| 51 | 603444 | 吉比特  | 37,400    | 18,367,514.00 | 0.48 |
| 52 | 02269  | 药明生物 | 513,500   | 17,777,549.21 | 0.47 |
| 53 | 002475 | 立讯精密 | 523,600   | 16,990,820.00 | 0.44 |
| 54 | 300763 | 锦浪科技 | 73,050    | 7,604,505.00  | 0.20 |
| 55 | 300860 | 锋尚文化 | 121,700   | 6,747,048.00  | 0.18 |
| 56 | 688249 | 晶合集成 | 74,041    | 1,391,155.62  | 0.04 |
| 57 | 688472 | 阿特斯  | 62,602    | 1,141,108.20  | 0.03 |
| 58 | 688443 | 智翔金泰 | 30,329    | 933,162.53    | 0.02 |
| 59 | 688361 | 中科飞测 | 8,303     | 673,991.49    | 0.02 |
| 60 | 688576 | 西山科技 | 2,395     | 315,642.70    | 0.01 |
| 61 | 688582 | 芯动联科 | 6,476     | 299,402.44    | 0.01 |
| 62 | 301486 | 致尚科技 | 4,820     | 277,921.20    | 0.01 |
| 63 | 301307 | 美利信  | 6,865     | 230,766.00    | 0.01 |
| 64 | 688543 | 国科军工 | 4,094     | 228,607.10    | 0.01 |
| 65 | 688458 | 美芯晟  | 2,206     | 210,955.41    | 0.01 |
| 66 | 688623 | 二元科技 | 1,776     | 162,256.88    | 0.00 |
| 67 | 688593 | 新相微  | 9,584     | 161,565.56    | 0.00 |
| 68 | 688629 | 华丰科技 | 7,073     | 160,957.02    | 0.00 |
| 69 | 688334 | 西高院  | 8,879     | 157,912.84    | 0.00 |
| 70 | 301320 | 豪江智能 | 6,416     | 155,624.88    | 0.00 |
| 71 | 301397 | 溯联股份 | 3,618     | 152,606.80    | 0.00 |
| 72 | 688620 | 安凯微  | 10,157    | 135,209.66    | 0.00 |
| 73 | 301315 | 威士顿  | 2,253     | 132,828.53    | 0.00 |
| 74 | 301292 | 海科新源 | 5,824     | 116,421.76    | 0.00 |
| 75 | 688631 | 莱斯信息 | 3,357     | 108,400.08    | 0.00 |
| 76 | 301355 | 南王科技 | 5,624     | 99,516.05     | 0.00 |
| 77 | 301232 | 飞沃科技 | 1,643     | 99,339.12     | 0.00 |
| 78 | 688429 | 时创能源 | 3,452     | 98,752.08     | 0.00 |
| 79 | 301323 | 新莱福  | 2,277     | 97,593.33     | 0.00 |
| 80 | 688535 | 华海诚科 | 1,607     | 96,642.01     | 0.00 |
| 81 | 301358 | 湖南裕能 | 2,023     | 86,766.47     | 0.00 |
| 82 | 301157 | 华塑科技 | 1,498     | 83,481.42     | 0.00 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 83  | 301202 | 朗威股份 | 3,060  | 79,009.20 | 0.00 |
| 84  | 688603 | 天承科技 | 1,391  | 76,505.00 | 0.00 |
| 85  | 688469 | 中芯集成 | 13,800 | 74,658.00 | 0.00 |
| 86  | 301261 | 恒工精密 | 1,973  | 72,803.70 | 0.00 |
| 87  | 688531 | 日联科技 | 346    | 47,045.62 | 0.00 |
| 88  | 301325 | 曼恩斯特 | 364    | 39,293.80 | 0.00 |
| 89  | 688146 | 中船特气 | 1,011  | 38,549.43 | 0.00 |
| 90  | 001286 | 陕西能源 | 3,767  | 35,447.47 | 0.00 |
| 91  | 301301 | 川宁生物 | 3,574  | 32,023.04 | 0.00 |
| 92  | 601061 | 中信金属 | 4,016  | 30,441.28 | 0.00 |
| 93  | 001287 | 中电港  | 1,386  | 29,133.72 | 0.00 |
| 94  | 301246 | 宏源药业 | 931    | 28,591.01 | 0.00 |
| 95  | 688352 | 颀中科技 | 2,361  | 28,497.27 | 0.00 |
| 96  | 301293 | 三博脑科 | 333    | 23,782.86 | 0.00 |
| 97  | 301297 | 富乐德  | 1,015  | 22,847.65 | 0.00 |
| 98  | 301322 | 绿通科技 | 391    | 20,816.84 | 0.00 |
| 99  | 301317 | 鑫磊股份 | 694    | 18,161.98 | 0.00 |
| 100 | 688478 | 晶升股份 | 402    | 17,032.74 | 0.00 |
| 101 | 688562 | 航天软件 | 726    | 16,197.06 | 0.00 |
| 102 | 301439 | 泓淋电力 | 949    | 16,038.10 | 0.00 |
| 103 | 301332 | 德尔玛  | 1,122  | 15,405.06 | 0.00 |
| 104 | 301408 | 华人健康 | 879    | 14,899.05 | 0.00 |
| 105 | 301419 | 阿莱德  | 330    | 14,470.50 | 0.00 |
| 106 | 688433 | 华曙高科 | 418    | 13,167.00 | 0.00 |
| 107 | 301360 | 荣旗科技 | 134    | 12,408.40 | 0.00 |
| 108 | 301345 | 涛涛车业 | 266    | 12,406.24 | 0.00 |
| 109 | 603135 | 中重科技 | 628    | 11,234.92 | 0.00 |
| 110 | 301141 | 中科磁业 | 262    | 11,184.78 | 0.00 |
| 111 | 601065 | 江盐集团 | 875    | 10,360.00 | 0.00 |
| 112 | 688479 | 友车科技 | 332    | 9,790.68  | 0.00 |
| 113 | 301357 | 北方长龙 | 190    | 9,194.10  | 0.00 |
| 114 | 301386 | 未来电器 | 378    | 8,992.62  | 0.00 |
| 115 | 301373 | 凌玮科技 | 277    | 8,822.45  | 0.00 |
| 116 | 601133 | 柏诚股份 | 664    | 8,140.64  | 0.00 |
| 117 | 301203 | 国泰环保 | 225    | 7,740.00  | 0.00 |
| 118 | 301337 | 亚华电子 | 232    | 7,045.84  | 0.00 |
| 119 | 301428 | 世纪恒通 | 229    | 7,007.40  | 0.00 |
| 120 | 001380 | 华纬科技 | 170    | 5,232.60  | 0.00 |
| 121 | 603125 | 常青科技 | 160    | 3,924.80  | 0.00 |
| 122 | 001328 | 登康口腔 | 145    | 3,696.05  | 0.00 |
| 123 | 001360 | 南矿集团 | 177    | 2,631.99  | 0.00 |
| 124 | 603137 | 恒尚节能 | 139    | 2,375.51  | 0.00 |
| 125 | 001324 | 长青科技 | 114    | 2,234.40  | 0.00 |

|     |        |      |    |          |      |
|-----|--------|------|----|----------|------|
| 126 | 001367 | 海森药业 | 55 | 2,171.40 | 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  | 00700  | 腾讯控股 | 202,365,358.76 | 4.74           |
| 2  | 002044 | 美年健康 | 180,266,648.93 | 4.22           |
| 3  | 02269  | 药明生物 | 164,571,503.83 | 3.86           |
| 4  | 688019 | 安集科技 | 136,853,945.78 | 3.21           |
| 5  | 300750 | 宁德时代 | 132,204,979.67 | 3.10           |
| 6  | 002254 | 泰和新材 | 123,976,289.84 | 2.90           |
| 7  | 000799 | 酒鬼酒  | 119,749,350.39 | 2.81           |
| 8  | 300627 | 华测导航 | 114,497,909.29 | 2.68           |
| 9  | 002409 | 雅克科技 | 105,704,090.60 | 2.48           |
| 10 | 300037 | 新宙邦  | 104,866,099.09 | 2.46           |
| 11 | 000596 | 古井贡酒 | 96,875,295.60  | 2.27           |
| 12 | 000063 | 中兴通讯 | 91,052,545.60  | 2.13           |
| 13 | 603369 | 今世缘  | 90,661,834.67  | 2.12           |
| 14 | 002439 | 启明星辰 | 89,234,870.00  | 2.09           |
| 15 | 002271 | 东方雨虹 | 87,707,457.71  | 2.05           |
| 16 | 000333 | 美的集团 | 87,630,198.06  | 2.05           |
| 17 | 688012 | 中微公司 | 84,417,577.01  | 1.98           |
| 18 | 002841 | 视源股份 | 83,512,034.92  | 1.96           |
| 19 | 688072 | 拓荆科技 | 81,844,535.78  | 1.92           |
| 20 | 300498 | 温氏股份 | 79,972,025.40  | 1.87           |

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  | 600809 | 山西汾酒 | 208,164,488.95 | 4.88           |
| 2  | 600150 | 中国船舶 | 191,879,575.93 | 4.50           |
| 3  | 300498 | 温氏股份 | 170,081,664.94 | 3.98           |
| 4  | 03690  | 美团-W | 166,425,454.94 | 3.90           |
| 5  | 300347 | 泰格医药 | 151,737,896.77 | 3.55           |
| 6  | 300699 | 光威复材 | 145,062,568.58 | 3.40           |
| 7  | 02269  | 药明生物 | 138,467,276.41 | 3.24           |
| 8  | 601888 | 中国中免 | 127,605,022.65 | 2.99           |
| 9  | 688777 | 中控技术 | 125,131,301.34 | 2.93           |
| 10 | 002311 | 海大集团 | 121,895,085.52 | 2.86           |
| 11 | 00291  | 华润啤酒 | 121,240,321.72 | 2.84           |

|    |        |       |                |      |
|----|--------|-------|----------------|------|
| 12 | 000858 | 五 粮 液 | 116,434,616.01 | 2.73 |
| 13 | 000799 | 酒鬼酒   | 109,027,800.13 | 2.55 |
| 14 | 002180 | 纳思达   | 108,230,135.26 | 2.54 |
| 15 | 000063 | 中兴通讯  | 85,774,604.38  | 2.01 |
| 16 | 002027 | 分众传媒  | 85,311,453.44  | 2.00 |
| 17 | 603517 | 绝味食品  | 80,246,360.25  | 1.88 |
| 18 | 688019 | 安集科技  | 79,950,601.75  | 1.87 |
| 19 | 600872 | 中炬高新  | 78,927,186.16  | 1.85 |
| 20 | 002841 | 视源股份  | 71,423,122.60  | 1.67 |

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 | 5,234,861,574.81 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 5,412,772,093.35 |

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） | 2,685,035.69 | 0.07         |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 2,685,035.69 | 0.07         |

#### 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  | 118030 | 睿创转债 | 18,520 | 2,685,035.69 | 0.07         |

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则，根据风险管理原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

深圳新宙邦科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国浦东海事局的处罚。

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额            |
|----|-------|---------------|
| 1  | 存出保证金 | 1,099,560.49  |
| 2  | 应收清算款 | 40,929,746.65 |
| 3  | 应收股利  | 440,088.57    |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 51,831.00     |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 42,521,226.71 |

#### 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

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  | 688019 | 安集科技 | 27,180,000.00 | 0.71          | 询价转让流通受限 |

#### 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

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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 (%) |
| 92,243       | 62,986.77     | 10,970,848.59 | 0.19       | 5,799,117,795.16 | 99.81      |

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 48,019.23  | 0.000826     |

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 0~10               |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | -                  |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2021 年 1 月 15 日）<br>基金份额总额 | 7,910,597,092.68 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 6,188,766,979.25 |
| 本报告期基金总申购份额                        | 23,225,293.77    |
| 减：本报告期基金总赎回份额                      | 401,903,629.27   |
| 本报告期基金拆分变动份额                       | -                |
| 本报告期末基金份额总额                        | 5,810,088,643.75 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 交易单元数量 | 股票交易             |                  | 应支付该券商的佣金    |                | 备注 |
|--------------|--------|------------------|------------------|--------------|----------------|----|
|              |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 中国国际金融股份有限公司 | 2      | 1,873,742,599.90 | 17.67            | 1,737,244.62 | 17.85          | -  |
| 国海证券股份有限公司   | 1      | 1,273,827,042.18 | 12.01            | 1,178,231.60 | 12.10          | -  |
| 申万宏源证券有限公司   | 1      | 971,575,894.42   | 9.16             | 904,821.49   | 9.29           | -  |
| 天风证券股份有限公司   | 1      | 857,400,989.06   | 8.09             | 775,801.74   | 7.97           | -  |
| 广发证券股份有限公司   | 2      | 675,921,804.92   | 6.37             | 629,487.81   | 6.47           | -  |
| 太平洋证券股份有限公司  | 2      | 675,767,512.05   | 6.37             | 619,180.71   | 6.36           | -  |
| 华创证券有限责任公司   | 1      | 674,546,355.87   | 6.36             | 622,520.05   | 6.39           | -  |
| 兴业证券股份有限公司   | 2      | 563,376,382.66   | 5.31             | 514,826.38   | 5.29           | -  |
| 第一创业证券股份有限公司 | 1      | 499,737,129.11   | 4.71             | 447,563.24   | 4.60           | -  |
| 瑞银证券有限责任公司   | 2      | 480,127,202.12   | 4.53             | 447,135.67   | 4.59           | -  |
| 中信建投证券股份有限公司 | 2      | 456,886,810.67   | 4.31             | 413,369.27   | 4.25           | -  |
| 中信证券股份有限公司   | 3      | 375,179,629.29   | 3.54             | 342,175.03   | 3.52           | -  |

|                |   |                |      |            |      |           |
|----------------|---|----------------|------|------------|------|-----------|
| 开源证券股份有限公司     | 1 | 371,260,619.85 | 3.50 | 324,371.75 | 3.33 | 本报告新增 1 个 |
| 安信证券股份有限公司     | 2 | 335,103,856.67 | 3.16 | 312,080.38 | 3.21 | -         |
| 东亚前海证券有限责任公司   | 1 | 204,794,045.44 | 1.93 | 177,120.14 | 1.82 | -         |
| 国信证券股份有限公司     | 1 | 204,235,365.45 | 1.93 | 190,203.64 | 1.95 | -         |
| 长城证券股份有限公司     | 2 | 110,905,062.21 | 1.05 | 98,516.32  | 1.01 | -         |
| 东方财富证券股份有限公司   | 1 | -              | -    | -          | -    | -         |
| 东方证券股份有限公司     | 1 | -              | -    | -          | -    | -         |
| 方正证券股份有限公司     | 1 | -              | -    | -          | -    | -         |
| 高盛(中国)证券有限责任公司 | 1 | -              | -    | -          | -    | -         |
| 光大证券股份有限公司     | 1 | -              | -    | -          | -    | 本报告新增 1 个 |
| 国都证券股份有限公司     | 1 | -              | -    | -          | -    | 本报告新增 1 个 |
| 国盛证券有限责任公司     | 1 | -              | -    | -          | -    | -         |
| 海通证券股份有限公司     | 1 | -              | -    | -          | -    | -         |
| 恒泰证券           | 2 | -              | -    | -          | -    | -         |

|                      |   |   |   |   |   |   |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 股份有限<br>公司           |   |   |   |   |   |   |
| 平安证券<br>股份有限<br>公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞信证券<br>(中国)有<br>限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券<br>股份有限<br>公司   | 3 | - | - | - | - | - |
| 中国银河<br>证券股份<br>有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国中金<br>财富证券<br>有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券<br>股份有限<br>公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券<br>股份有限<br>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，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

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

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 债券交易 |                 | 债券回购交易 |                   | 权证交易 |                 |
|--------------|------|-----------------|--------|-------------------|------|-----------------|
|              | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) |
| 中国国际金融股份有限公司 | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国海证券股份有限公司   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 申万宏源证券有限公司   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 天风证券股份有限公司   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 广发证券股份有限公司   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 太平洋证券股份有限公司  | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 华创证券有限责任公司   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 兴业证券股份有限公司   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 第一创业证券股份有限公司 | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 瑞银证          | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |

|                          |   |   |                |        |   |   |   |
|--------------------------|---|---|----------------|--------|---|---|---|
| 券有限<br>责任公<br>司          |   |   |                |        |   |   |   |
| 中信建<br>投证券<br>股份有<br>限公司 | - | - | -              | -      | - | - | - |
| 中信证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | -              | -      | - | - | - |
| 开源证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | -              | -      | - | - | - |
| 安信证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | 220,452,000.00 | 100.00 | - | - | - |
| 东亚前<br>海证券<br>有限责<br>任公司 | - | - | -              | -      | - | - | - |
| 国信证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | -              | -      | - | - | - |
| 长城证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | -              | -      | - | - | - |
| 东方财<br>富证券<br>股份有<br>限公司 | - | - | -              | -      | - | - | - |
| 东方证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | -              | -      | - | - | - |
| 方正证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | -              | -      | - | - | - |
| 高盛(中<br>国)证券             | - | - | -              | -      | - | - | - |

|                              |   |   |   |   |   |   |   |
|------------------------------|---|---|---|---|---|---|---|
| 有限责<br>任公司                   |   |   |   |   |   |   |   |
| 光大证<br>券股份<br>有限公<br>司       | - | - | - | - | - | - | - |
| 国都证<br>券股份<br>有限公<br>司       | - | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证<br>券有限<br>责任公<br>司       | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通证<br>券股份<br>有限公<br>司       | - | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证<br>券股份<br>有限公<br>司       | - | - | - | - | - | - | - |
| 平安证<br>券股份<br>有限公<br>司       | - | - | - | - | - | - | - |
| 瑞信证<br>券（中<br>国）有<br>限公<br>司 | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商证<br>券股份<br>有限公<br>司       | - | - | - | - | - | - | - |
| 中国银<br>河证券<br>股份有<br>限公司     | - | - | - | - | - | - | - |
| 中国中<br>金财富<br>证券有<br>限公司     | - | - | - | - | - | - | - |
| 中航证<br>券股份<br>有限公<br>司       | - | - | - | - | - | - | - |

|                        |   |   |   |   |   |   |
|------------------------|---|---|---|---|---|---|
| 司                      |   |   |   |   |   |   |
| 中泰证<br>券股份<br>有限公<br>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旗下部分基金 2023 年非港股通交易日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回及转换业务安排的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 1 月 4 日  |
| 2  | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告                     | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 1 月 17 日 |
| 3  | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告                            | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 1 月 20 日 |
| 4  | 景顺长城产业趋势混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告                                  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 1 月 20 日 |
| 5  | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 2 月 10 日 |
| 6  | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 2 月 24 日 |
| 7  | 关于旗下部分基金在 2023 年度新增港股通交易日照常开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告                 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 3 月 6 日  |
| 8  | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 3 月 25 日 |
| 9  | 景顺长城产业趋势混合型证券投资基金 2022 年年度报告                                      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 3 月 28 日 |
| 10 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告                                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 3 月 28 日 |
| 11 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告                     | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 6 日  |
| 12 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 8 日  |
| 13 | 关于旗下部分基金新增杭州银行股份有限公司杭 e 家平台为销售平台并开通基金转换业务及参加申购费率优惠的公告             | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 12 日 |
| 14 | 景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示                                       | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 18 日 |
| 15 | 景顺长城产业趋势混合型证券投资基  | 中国证监会指定报刊及   | 2023 年 4 月 21 日 |

|    |  |              |                 |
|----|--|--------------|-----------------|
|    | 金 2023 年第 1 季度报告   | 网站           |                 |
| 16 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告                                   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 21 日 |
| 17 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 22 日 |
| 18 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 6 日  |
| 19 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 13 日 |
| 20 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告                            | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 23 日 |
| 21 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 27 日 |
| 22 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 10 日 |
| 23 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 17 日 |
| 24 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增开源证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 20 日 |
| 25 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 22 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与本基金的基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2023 年 8 月 22 日起，调低本基金的管理费率和托管费率并对基金合同有关条款进行修订。详情请参阅本基金管理人于 2023 年 8 月 18 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。

## § 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产业趋势混合型证券投资基金募集注册的文件；

- 2、《景顺长城产业趋势混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城产业趋势混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城产业趋势混合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

2023 年 8 月 30 日