

# 景顺长城公司治理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 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	5
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 .....	6
3.3 其他指标 .....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	8
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 .....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
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 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
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 .....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	20
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	42
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 .....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	47

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</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 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城公司治理混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城公司治理混合
场内简称	无
基金主代码	260111
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 10 月 22 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	286,119,294.43 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于具有良好公司治理的上市公司的股票，以及因治理结构改善而使公司内部管理得到明显提升的上市公司的股票，在控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金依据以宏观经济分析模型（MEM）为基础的资产配置模型决定基金的资产配置，运用景顺长城“股票研究数据库（SRD）”等分析系统，基于公司治理评价体系和 FVMC 等选股模型作为个股选择的依据，同时依据景顺长城风险管理系统和绩效评估系统进行投资组合的调整，以谋求基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+中证全债指数×20%。
风险收益特征	本基金是风险程度高的投资品种。

### 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 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	4,658,822.41
本期利润	68,529,811.48
加权平均基金份额本期利润	0.2542
本期加权平均净值利润率	16.02%
本期基金份额净值增长率	18.79%
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	133,461,644.67
期末可供分配基金份额利润	0.4665
期末基金资产净值	470,516,174.37
期末基金份额净值	1.644
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	367.47%

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三位，小数点后第四位四舍五入，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

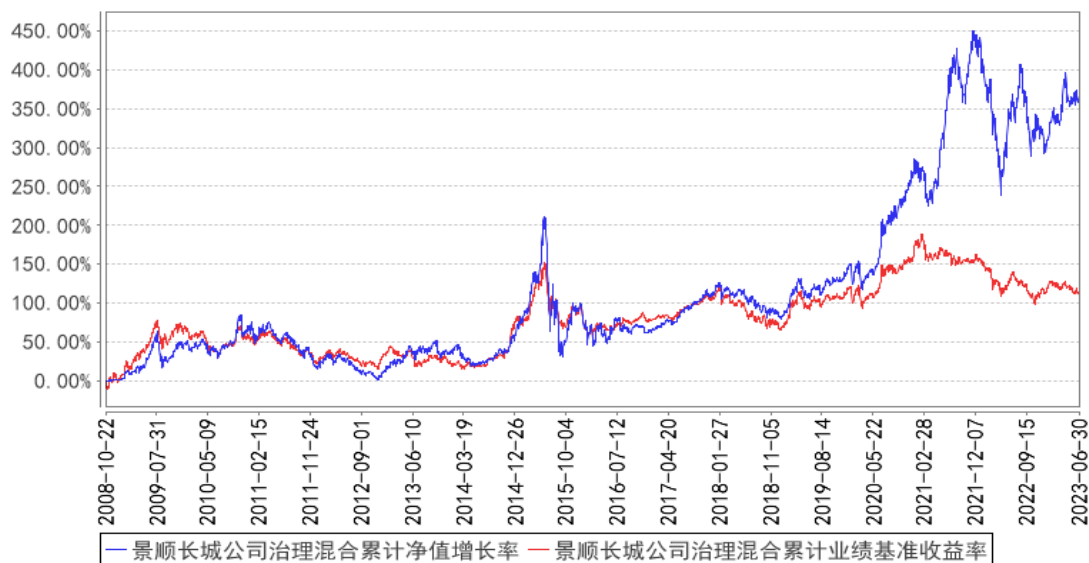
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.92%	1.00%	1.05%	0.69%	-0.13%	0.31%
过去三个月	2.37%	1.23%	-3.73%	0.66%	6.10%	0.57%
过去六个月	18.79%	1.15%	0.05%	0.67%	18.74%	0.48%

过去一年	1.29%	1.35%	-10.66%	0.79%	11.95%	0.56%
过去三年	77.73%	1.50%	-3.05%	0.96%	80.78%	0.54%
自基金合同生效起至今	367.47%	1.60%	113.86%	1.19%	253.61%	0.41%

### 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

景顺长城公司治理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：本基金的资产配置比例为：股票投资 65%–95%，债券投资 0%–30%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%–35%，权证投资 0%–3%。本基金投资于基金名称显示投资方向的股票不低于基金股票投资的 80%；本基金自 2008 年 10 月 22 日合同生效日起至 2009 年 4 月 21 日为建仓期。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		
杨锐文	本基金的基金经理	2020 年 7 月 25 日	-	13 年	工学硕士、理学硕士。曾任上海常春藤衍生投资公司分析部高级分析师。2010 年 11 月加入本公司，担任研究部研究员，自 2014 年 10 月起担任股票投资部基金经理，现任股票投资部执行总监、基金经理。具有 13 年证券、基金行业从业经验。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

上半年，国内经济弱复苏力度弱于预期，但是，一切已经走向正循环，随着时间的推移，我们相信企业信心和消费者信心将会不断增强，复苏力度会逐步增强。上半年，TMT 相关股票表现强势，地产、新能源及消费相关的股票表现弱势。沪深 300 下跌 0.75%，而创业板指和科创 50 表现分化，分别下跌 5.61%和上涨 4.71%。

上半年，我们的基金表现较佳，跑赢基准。期间的组合增加了半导体、工业母机相关的仓位，降低了新能源车和消费相关仓位。我们降低了前五大仓位的比重，希望通过这样降低重仓股波动的冲击，提升组合的鲁棒性和灵活性。我们依然一直保留着初心，始终坚持投资具有伟大前景的新兴产业企业，并伴随他们的成长，而不是趋势增强、寻求市场热点。我们相信未来的胜者一定是不断高强度投入的企业。尽管这些企业不一定是当前的焦点，但是，我们相信厚积薄发才能换取长期的发展。尽管这个过程充满艰难与痛苦，我们仍会坚持我们的选择和风格，也会不断优化和改进我们的持仓组合。

从 2018 年至今，全球先后经历了贸易摩擦、新冠疫情冲击所致的安全风险带来的产业链重构，以及俄乌地缘政治冲突暴发以来意识形态对立对全球化的巨大冲击，导致逆全球化措施不断升级，经济发展不再是各国政府的唯一考量，各种意义上的安全（国防安全、经济安全、政治安全、供应链安全等）成为这个时期更重要的议题，地缘政治成本成为逆全球化的主要推手。逆全球化浪潮的兴起，也给全球的经济增长带来了巨大的不确定性，寻求降低地缘政治成本成为未来全球化面临的巨大挑战。

近年来，制裁和管制事件越来越频发，以半导体为代表的高科技领域表现得尤其突出。虽然这不可避免对产业的发展造成了一定的冲击，但长期而言，这也是变相逼迫着大家抛弃幻想，极大加速了科技产业的自主可控的进程。中国的自主可控大潮的号角声已经吹响，这已经是不可阻挡的趋势。我们的投资也应该顺应时代，也要认清全球化时代的冲击和挑战，很多投资逻辑和框架都将发生巨大的变化。

与此同时，虽然疫情已经走向结束，但是，过去三年的疫情造成各类主体的资产负债表受损严重，出现明显的疤痕效应，尽管疫情已经过去了，但是，经济不可能像一些人预期那样出现报复性反弹。我们政府鼓励大家通过劳动获取收入，而不是通过“发钱”的形式来刺激消费，这决定我们的消费复苏一定是缓慢的，但会更具有持续性。今年以来，政府也不断强调支持和加强民营经济，随着市场信心的修复，活力自然会好起来，一切将走向正循环。但是，过高的居民资产负债率束缚了居民加杠杆的能力以及人口拐点已现，房地产不可能回到从前。地产时代的落幕，这同样会制约地方政府的投资能力，老的道路已经走不通了，这决定了未来的经济增长将会更加倚重以数字经济和新基建为代表的新的增长引擎。

在上个季度报告中，我们表达了非常鲜明看好市场的观点，我们本季度继续旗帜鲜明看好市场，我们认为行情可能才刚刚开始，深信机会已经到来，我们在去年寒冬时期埋下希望与坚持的种子，深信将会生根发芽，迎来阳光灿烂，争取给投资者带来良好的回报。

从全球经济的角度，周边的形势给我们带来越来越大的挑战。美联储史无前例的快速加息过程中，欧美银行不断暴雷，政府发钱刺激消费的边际效益越来越弱，需求颓势越来越明显，其中，欧洲问题尤其严重。欧洲的工业过去很大程度依赖于俄罗斯的廉价能源，俄乌冲突以及北溪管道被炸让欧洲的能源问题几乎成为不可控的问题。欧洲的低能源成本优势或许已经一去不复返了，这对欧洲的工业体系或许带来毁灭性的打击。欧洲的困境同时也让全球经济陷入增长泥潭中，但是从相对来看，中美会是相对受益的。世界格局在急剧变化，时势越发混沌，中美这样的大国在经济、政治的稳定性上的优势将会表现得淋漓尽致。因此，我们的发展更取决于我们自身在这场百年不遇之变局中的表现，过去三十年打造了号称“世界工厂”的制造业将是确保我们继续平稳前行的砝码。

美国的经济韧性是超出我们预期的，这也意味着美联储的货币政策预计会持续收紧，直到经济带来的痛苦大于通胀带来的痛苦。美国在科技与金融上的统治力使其经济几乎一枝独秀的表现，但是，美国加息带来的资金回流将会全面推升其他国家的资金成本，欧洲及其他国家的日子越发艰难，这对我们的出口也带来巨大的压力。

#### 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 18.79%，业绩比较基准收益率为 0.05%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球当下最大的挑战还是经济缺乏强劲的引擎。从区域角度来看，欧美国家的颓势已经难以避免，中国经济引擎的边际推动力也在逐步下降，而亚非拉的其他发展中国家仍然看不到顶上来趋势。新的增长引擎的缺失，伴随着的是资源的相对匮乏，这使得全球不可避免地走向各种形

式地内卷。这不限于国与国之间的内卷，还包括同一国家不同区域、民族、阶层之间的内卷，这势必加大冲突的可能性。

俄乌冲突已经证明了钢铁洪流已经失效，现代比的是信息化，背后就是 AI 和半导体。换句话说，国家竞争表象是军事实力的竞争，实际上是 AI 与半导体的竞争。尤其 Chat GPT 的横空出世，更是为大家指明了 AI 的突破口，让我们看到新一轮的科技革命到来的希望，GPT 有望接替当年的互联网给全球经济带来一场效率革命。无论从安全角度还是从效率角度，全球主要经济体和主要的企业都会疯狂投入在 AI 和半导体上，这几乎是不可阻挡的产业趋势。

面对着百年不遇之变局，我们国家把容易做的事情几乎已经做完了，剩下的几乎都是硬骨头。我们跨越中等收入陷阱的前提是产业的升级和自主可控，否则就是无根之木、无源之水。因此，自主可控（安全链）将会是未来十年国内市场最重要的投资主轴之一，包括且不限于半导体、软件、工业母机、新材料等细分产业链。这其中首当其冲的、也是最重要的，莫过于半导体产业链。

这几年，美国对我国半导体的制裁不断升级，使得我们追赶先进制程之路变得极为艰巨。加之半导体供应链非常精密复杂，历来都是全球高度分工，仅靠自己覆盖所有的产业链更是难上加难。市场的观点两极分化，摇摆不断，时而盲目乐观、张冠李戴；时而无比悲观、危言耸听。事实上，我国半导体的发展既不可能“速胜”，也不会是“必败”的，自主可控其实是一场“持久战”，未来确实路漫漫其修远兮，半导体的发展不是一日之功，但我们对中长期充满信心。

半导体制造是全球最复杂、最高科技的产业之一，但它的技术演进大部分时候并不属于颠覆式创新，更多的是微创新，需要对工艺和细节不断的深耕、攻坚和打磨；半导体的规模和技术工艺的积淀很重要，在过去没有限制的时候，客户更多考虑的是价格、配套和质量稳定性，那么对于中国企业而言，连试用机会都没有。巧妇难为无米之炊，没有机会意味着没有迭代和进步。温水煮青蛙，最终结局不言而喻。制裁和打压并不是洪水猛兽，更重要是唤醒了所有中国企业自主可控的动力。当我们的企业有了机会，一切皆为可能。我们拥有天量的工程师，我们足够的吃苦耐劳，只要下游肯给机会，假以时日，就一定能做好这个产业。

但我们仍要承认，这条产业链囊括了从芯片到设备、材料、软件工具，再到甚至量测仪器的种种细节，每一个环节都不是我们能快速掌握的。其中，最尖端的半导体设备更是人类科技皇冠上的明珠，中短期仅凭我国一己之力实现完全攻克是不现实的。我们还是需要广泛的国际合作。先进制程受阻并不那么可怕，成熟制程的市场空间就足够广阔，足够中国企业的的发展和翱翔。也只有通过成熟制程的发展哺育和壮大产业链，才能有机会让先进制程进一步突破。不积跬步，无以至千里。

事实上，每个崛起的新兴行业在发展初期都是饱受质疑的，例如 2018 年光伏产业曾经全行业

哀嚎遍野，唱空的人不计其数，但是，之后才是光伏行业高光时刻的起点；同样，新能源车也曾经被质疑不过是靠补贴喂养大的巨婴，市场需求主要靠 To B，补贴取消必然是行业的灭顶之灾，但是，今天国产新能源车的强势崛起已经有目共睹。对于这些新兴成长行业，悲观者的质疑永远都是看似明智和有道理的，静态看问题总是只能看到问题，但是，路是走出来的，困难是用来克服的，只有乐观者才能赢得未来。中国制造业从最开始的生产衣服和袜子，一步步往上走，才成就了今天举世瞩目的制造业的“世界工厂”。没有人能在那个时候想到今天的发展，我们今天也没有理由不自信。我们深信半导体产业一定会发展起来，真正实现产业的升级，成就更辉煌和灿烂的未来。

回顾半导体发展史，我们会发现以华人为代表的东亚人在半导体领域是具有统治力的影响，半导体的制造中心从欧美转移到中国也是有历史的必然性的。究其原因还是半导体的制造是一项非常辛苦的活，长期穿着防护服，身上不能带通信设备，上班如坐牢一样各种限制，因此，做好半导体制造需要很强的吃苦耐劳精神和很高的纪律性，这是东亚人所具备的特质。因此，从上世纪 80/90 年代开始，日本、中国台湾、韩国的良率就比美国本土高一截，美国半导体工厂的成本居高不下，导致了整个半导体制造从欧美向亚太转移。即便是现存的美本土工厂的工程师也是以华人为主，即使不考虑制造环节，无论芯片设计环节还是 EDA 软件，这些环节的龙头公司也大部分都是华人掌舵，我们深信中国人有做好半导体的天赋和能力。

除了自主可控方向，AI 的高速成长也几乎是确定的趋势。从 GPT4.0 展现出的能力，AI GPT 将替代部分重复性的白领工作已经毋庸置疑了，这犹如当年机器替代简单的体力劳动一样，简单的脑力劳动的替代也正式开始了。当然，我们不仅要看到 GPT 对部分工作的替代，更应该关注 GPT 能否创造出更多的新需求和新场景。GPT 冲击波将席卷几乎所有大型的互联网公司，这些互联网公司无论主动还是被动都将不得不卷入这一轮 AI 的大潮中，新一轮的算力“军备竞赛”毫无疑问已经开始了。但是，从短期来看，AI 是否过热还是需要斟酌的，行业发展需要时间，不可能一蹴而就，行业应用也同样需要不断适配从而找出最佳的落地模式。不过，我们长期看好 AI 的发展，未来也会投入大量的时间和精力扎根在这个行业的研究。

对于新能源智能车板块，我们相对上个季度更加乐观了。首先，在电动化领域，经过一年半的急剧调整，产业资本也从盲目过热到瞬间冰冻，新能源车反倒是走向越来越健康的方向。尽管经济复苏还是比较弱势，但是，新能源车的增长动能依然较为强劲，毫无疑问，电动化的大趋势已经是不可阻挡了。锂电产业链也进入落后产能逐渐淘汰阶段，具备成本优势的企业预计在这一波产能出清时期展现自身强大的竞争力，而当前电动化板块估值泥沙俱下，这带来很多错杀的机会。其次，在汽车零部件领域，核心逻辑将由国产化率提升进阶为全球市占率提升，我们可以看

到国内一些汽车零部件企业逐渐在海外布局设厂，配套海外车企，凭借成本优势和配套服务不断的抢占海外市场份额。最后，在智能化领域，国内外车企通过引入 AI 加速智能化的推广，同时 L3 自动驾驶的加速落地也在助力行业的发展，我们期待那么一天，消费者尝试了智能汽车驾驶的乐趣后，再也回不去非智能汽车的时代，正犹如当年消费者尝试了电动车后，再也回不去燃油车的时代一样，未来汽车板块更多的机会可能来自于智能化，而非电动化。汽车是一个巨大的产业链，也是我们国家的优势产业，我们坚信，未来会有一批批国内的整车和零部件企业逐渐走向世界的舞台，成长为具备全球竞争力的企业。

市场同样对消费板块处于极度悲观的状态，但是，我们反倒是乐观了。疫情的疤痕效应会逐步消退，现在毋庸置疑是较差的时候，消费会走向复苏。但是，未来消费的机会不一定会和过去的机会是一样的，在共同富裕的大背景之下，消费升级和降级会同时发生。地产时代的落幕同样会冲击一部分消费行业，但是与此同时，这也会让居民支出转向于新型消费。新消费的崛起是为满足人们对美好生活的需求与向往所致。伴随着用户作为消费“主人”意识的全面觉醒，那种“生产什么就卖什么，我卖什么你就买什么”的“卖方市场”消费观念和“唯价格论”早已被摒弃，消费者越来越重视产品本身，懂用户以及能顺应用户心智诉求转变越来越主导未来的消费，能为用户创造价值、传递价值的消费品牌会越来越有价值。我们在消费领域将会增加这类型公司的投资。

#### 关于基金的策略容量

我们现在管理的优选、环保优势和创新成长等三支基金均定位为全行业基金，主要采取之前季报所描述的企业生命力评估的方法论策略。它们不仅会投资在企业成长爆发阶段，也会有大量投资于陪伴企业成长的早中期阶段，市值分布从 30 亿至万亿不等，行业分布也较为分散，体现为多层次均衡式投资。

景顺长城成长龙头也定位为全行业基金，但是投资的企业会更偏重于大市值龙头成长股。

景顺长城公司治理基金和成长领航基金同样定位于均衡成长，但有较多仓位投资于以专精特新为代表的中小市值股票。

景顺长城改革机遇基金的持仓结构基本与公司治理、成长领航一致，唯一不同就是仓位，改革机遇的仓位预计会在 50-80%之间波动，大部分时间会在 60-70%之间。

景顺长城电子信息产业与新能源产业均是团队管理的行业型基金，分别聚焦于科技股与新能源产业。由于聚焦于科技股和新能源产业，这两个基金会体现较高的波动率。我们希望通过产业切入的方式实现持续的超额收益，并通过更专业的产业投资让投资者分享产业成长的红利。

我们不同的基金将会根据基金本身的规模、策略容量、申购赎回冲击力等因素制定申购限制，

总体原则是希望基金规模相对平稳，避免规模急剧波动，这样可以确保申购赎回对基金的冲击尽可能小。

#### 结束语

上半年开了一个不错的开头，我们希望再接再厉，尽早收复失地，争取为所有持有人都能带来良好的回报，不辜负大家的期待。展望下半年，我对市场充满信心，我深信我们埋下的希望和坚持的种子一定会生根发芽，给持有人带来丰硕的果实。谢谢大家过去一年不离不弃的陪伴，我们努力做好，希望能为所有持有人带来正回报。

#### 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：景顺长城公司治理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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	36,948,713.23	30,283,597.22
结算备付金		541,039.33	321,946.67
存出保证金		66,081.03	67,204.97
交易性金融资产	6.4.7.2	435,669,273.16	327,497,754.92
其中：股票投资		435,669,273.16	327,497,754.92
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	207,576.58
应收股利		-	-
应收申购款		443,496.03	518,337.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		473,668,602.78	358,896,417.64
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 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		1,310,333.75	-
应付赎回款		661,132.45	289,719.88
应付管理人报酬		571,955.80	472,488.47
应付托管费		95,326.00	78,748.06
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	3.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	513,680.41	270,600.56
负债合计		3,152,428.41	1,111,560.17
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	286,119,294.43	258,445,396.43
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	184,396,879.94	99,339,461.04
净资产合计		470,516,174.37	357,784,857.47
负债和净资产总计		473,668,602.78	358,896,417.64

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.644 元，基金份额总额 286,119,294.43 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城公司治理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 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		72,347,352.93	-44,482,574.09
1. 利息收入		63,494.83	49,327.30
其中：存款利息收入	6.4.7.13	63,494.83	49,327.30
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,348,193.53	4,851,432.63
其中：股票投资收益	6.4.7.14	5,885,670.02	3,662,122.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	595,243.97	86,678.70
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,867,279.54	1,102,631.92
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	63,870,989.07	-49,471,253.16
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	64,675.50	87,919.14
<b>减：二、营业总支出</b>		3,817,541.45	2,848,359.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,176,877.14	2,347,454.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	529,479.60	391,242.36
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		1.40	0.22

8. 其他费用	6.4.7.23	111,183.31	109,662.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		68,529,811.48	-47,330,933.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		68,529,811.48	-47,330,933.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		68,529,811.48	-47,330,933.72

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城公司治理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 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）	258,445,396.43	-	99,339,461.04	357,784,857.47
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）	258,445,396.43	-	99,339,461.04	357,784,857.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	27,673,898.00	-	85,057,418.90	112,731,316.90
（一）、综合收益总额	-	-	68,529,811.48	68,529,811.48
（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）	27,673,898.00	-	16,527,607.42	44,201,505.42
其中：1. 基金申购款	67,285,274.02	-	41,058,646.26	108,343,920.28
2. 基金赎回款	-39,611,376.02	-	-24,531,038.84	-64,142,414.86
（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)	286,119,294.43	-	184,396,879.94	470,516,174.37
项目	上年度可比期间 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)	151,615,996.55	-	199,496,634.25	351,112,630.80
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)	151,615,996.55	-	199,496,634.25	351,112,630.80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	79,450,669.04	-	-55,449,050.18	24,001,618.86
(一)、综合收益总额	-	-	-47,330,933.72	-47,330,933.72
(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)	79,450,669.04	-	50,170,700.09	129,621,369.13
其中：1. 基金申购款	120,992,713.77	-	72,697,859.42	193,690,573.19
2. 基金赎回款	-41,542,044.73	-	-22,527,159.33	-64,069,204.06
(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)	-	-	-58,288,816.55	-58,288,816.55
(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)	231,066,665.59	-	144,047,584.07	375,114,249.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城公司治理混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第 707 号《关于核准景顺长城公司治理股票型证券投资基金募集的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城公司治理股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 273,029,372.01 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 152 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城公司治理股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 10 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 273,077,492.69 份基金份额,其中认购资金利息折合 48,120.68 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,景顺长城公司治理股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 5 日公告后更名为景顺长城公司治理混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城公司治理混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票(含存托凭证)、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的比例范围为:股票投资 65%-95%,债券投资 0%-30%,现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-35%,权证投资 0%-3%。本基金投资于基金名称显示投资方向的股票不低于基金股票投资的 80%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数 X80%+中证全债指数 X20%。

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

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、

中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起(如适用)产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	36,948,713.23
等于：本金	36,945,770.03
加：应计利息	2,943.20
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	36,948,713.23

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	437,541,261.12	-	435,669,273.16	-1,871,987.96
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	437,541,261.12	-	435,669,273.16	-1,871,987.96

#### 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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,293.81
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	414,126.45



其中：交易所市场	414,126.45
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	98,260.15
合计	513,680.41

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	258,445,396.43	258,445,396.43
本期申购	67,285,274.02	67,285,274.02
本期赎回（以“-”号填列）	-39,611,376.02	-39,611,376.02
本期末	286,119,294.43	286,119,294.43

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	116,513,766.16	-17,174,305.12	99,339,461.04
本期利润	4,658,822.41	63,870,989.07	68,529,811.48
本期基金份额交易产生的变动数	12,289,056.10	4,238,551.32	16,527,607.42
其中：基金申购款	30,068,808.53	10,989,837.73	41,058,646.26
基金赎回款	-17,779,752.43	-6,751,286.41	-24,531,038.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	133,461,644.67	50,935,235.27	184,396,879.94

#### 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	59,527.04
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	3,449.50	
其他	518.29	
合计	63,494.83	

## 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	5,885,670.02
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	5,885,670.02

## 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	358,862,122.30
减：卖出股票成本总额	351,868,014.84
减：交易费用	1,108,437.44
买卖股票差价收入	5,885,670.02

## 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	390.46
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	594,853.51
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	595,243.97

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,924,332.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,329,000.00
减：应计利息总额	401.98
减：交易费用	76.99

买卖债券差价收入	594,853.51
----------	------------

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,867,279.54
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,867,279.54

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	63,870,989.07
股票投资	63,870,989.07
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-

权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	63,870,989.07

#### 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	60,414.19
基金转换费收入	4,261.31
合计	64,675.50

#### 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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	18,600.00
银行划款手续费	649.08
存托服务费	2,674.08
合计	111,183.31

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
长城证券	6,892,227.40	0.93	5,075,807.00	0.86

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 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 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	6,449.95	0.94	6,449.95	1.56
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	4,727.19	0.86	4,727.19	1.89

注：1. 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。

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

##### 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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,176,877.14	2,347,454.30

其中：支付销售机构的客户维护费	912,727.78	631,166.39
-----------------	------------	------------

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	529,479.60	391,242.36

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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自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自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	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	36,948,713.23	59,527.04	26,945,675.90	45,292.82

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末（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	572	6,795.36	12,023.44	-
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	-
301039	中集车辆	2023年6	6个月	大宗	10.69	12.24	200,000	2,138,000.00	2,448,000.00	-

		月 1 日		交易 流通 受限						
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	-
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	50.00	30.71	472	23,600.00	14,495.12	-
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 29 日	6 个月	新股 流通 受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
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	3,199	15,995.00	28,663.04	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股 流通 受限	32.34	31.86	536	17,334.24	17,076.96	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股 流通	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-



				受限						
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	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股流通受限	131.11	53.24	135	17,699.85	7,187.40	-
301322	绿通科技	2023年5月25日	1-6个月(含)	新股流通受限	-	53.24	68	-	3,620.32	转增股
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	246	18,892.80	26,555.70	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,021	15,121.01	14,018.33	-
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	156	11,458.20	7,275.84	-
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	466	11,076.82	19,986.74	-
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	863	14,015.12	14,627.85	-
301419	阿莱德	2023年2	6个月	新股	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-

		月 2 日		流通受限						
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	528	10,554.72	8,923.20	-
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	3,076	177,362.16	177,362.16	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	57.66	57.66	342	19,719.72	19,719.72	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,262	8,303.96	9,565.96	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	489	5,066.04	5,789.76	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	453	5,281.98	5,553.78	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	148	3,845.04	3,630.44	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	423	7,529.40	7,567.47	-
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 5 月 22 日	6 个月	询价转让流通受限	205.00	151.88	10,000	2,050,000.00	1,518,800.00	-
688019	安集科技	2023 年 6 月 15 日	1-6 个月(含)	询价转让流通受限	-	151.88	3,000	-	455,640.00	转增股
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	20,000	3,133,600.00	3,020,000.00	-

688072	拓荆科技	2023年4月28日	6个月	询价 转让 流通 受限	352.00	387.02	10,000	3,520,000.00	3,870,200.00	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股 流通 受限	36.15	38.13	382	13,809.30	14,565.66	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股 流通 受限	19.86	18.06	2,654	52,708.44	47,931.24	-
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	1,189	14,386.90	14,351.23	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股 流通 受限	23.60	64.67	432	10,195.20	27,937.44	-
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	385	10,264.10	12,127.50	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股 流通 受限	37.88	29.49	988	37,425.44	29,136.12	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股 流通 受限	75.00	90.76	181	13,575.00	16,427.56	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股 流通 受限	5.69	5.41	5,003	28,467.07	27,066.23	-
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	327	11,114.73	9,643.23	-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股 流通 受限	152.38	135.97	139	21,180.82	18,899.83	-
688535	华海诚科	2023年3	6个月	新股	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-

		月 28 日		流通受限						
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	43.67	53.05	342	14,935.14	18,143.10	-
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	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	522	13,958.28	21,234.96	-
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	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
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	-
689009	九号公司	2023 年 6 月 15 日	6 个月	大宗交易流通受限	32.72	34.13	150,000	4,908,000.00	5,119,500.00	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，本基金未持有除国债、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（上年度末：同）。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	36,948,713.23	-	-	-	-	-	36,948,713.23
结算备付金	541,039.33	-	-	-	-	-	541,039.33
存出保证金	66,081.03	-	-	-	-	-	66,081.03
交易性金融资产	-	-	-	-	-	435,669,273.16	435,669,273.16
应收申购款	-	-	-	-	-	443,496.03	443,496.03
资产总计	37,555,833.59	-	-	-	-	436,112,769.19	473,668,602.78
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	661,132.45	661,132.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	571,955.80	571,955.80
应付托管费	-	-	-	-	-	95,326.00	95,326.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,310,333.75	1,310,333.75
其他负债	-	-	-	-	-	513,680.41	513,680.41
负债总计	-	-	-	-	-	3,152,428.41	3,152,428.41
利率敏感度缺口	37,555,833.59	-	-	-	-	-	-
上年度末 2022年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	30,283,597.22	-	-	-	-	-	30,283,597.22
结算备付金	321,946.67	-	-	-	-	-	321,946.67
存出保证金	67,204.97	-	-	-	-	-	67,204.97
交易性金融资产	-	-	-	-	-	327,497,754.92	327,497,754.92
应收申购款	-	-	-	-	-	518,337.28	518,337.28

应收证券清算款	-	-	-	-	207,576.58	207,576.58
资产总计	30,672,748.86	-	-	-	328,223,668.78	358,896,417.64
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	289,719.88	289,719.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	472,488.47	472,488.47
应付托管费	-	-	-	-	78,748.06	78,748.06
应交税费	-	-	-	-	3.20	3.20
其他负债	-	-	-	-	270,600.56	270,600.56
负债总计	-	-	-	-	1,111,560.17	1,111,560.17
利率敏感度缺口	30,672,748.86	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有债券资产（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 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	435,669,273.16	92.59	327,497,754.92	91.53
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	435,669,273.16	92.59	327,497,754.92	91.53
----	----------------	-------	----------------	-------

#### 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%	16,415,835.90	10,873,037.68
	沪深 300 指数下降 5%	-16,415,835.90	-10,873,037.68

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	417,914,199.63	323,502,965.15
第二层次	570,484.58	-
第三层次	17,184,588.95	3,994,789.77
合计	435,669,273.16	327,497,754.92

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

值对于公允价值的影响程度，确定相关股票的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	435,669,273.16	91.98
	其中：股票	435,669,273.16	91.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	37,489,752.56	7.91
8	其他各项资产	509,577.06	0.11
9	合计	473,668,602.78	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	381,134,535.70	81.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供	35,447.47	0.01

	应业		
E	建筑业	7,929.29	0.00
F	批发和零售业	36,217.25	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	17,582,078.97	3.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,638,634.49	3.75
J	金融业	-	-
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	37,242.13	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	796,188.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,400,999.86	3.91
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	435,669,273.16	92.59

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	689009	九号公司	567,313	20,497,484.05	4.36
2	688169	石头科技	61,501	19,722,140.68	4.19
3	002044	美年健康	2,584,700	18,377,217.00	3.91
4	688002	睿创微纳	405,648	18,173,030.40	3.86
5	002352	顺丰控股	389,933	17,582,078.97	3.74
6	300750	宁德时代	76,140	17,420,070.60	3.70
7	300567	精测电子	164,800	15,680,720.00	3.33
8	688012	中微公司	98,437	15,400,468.65	3.27
9	688521	芯原股份	206,431	14,846,517.52	3.16
10	002409	雅克科技	200,000	14,576,000.00	3.10
11	688220	翱捷科技	191,592	14,444,120.88	3.07
12	688213	思特威	270,171	13,816,544.94	2.94
13	002841	视源股份	206,500	13,802,460.00	2.93
14	688019	安集科技	79,313	12,628,211.79	2.68
15	688120	华海清科	40,664	10,249,361.20	2.18
16	600066	宇通客车	624,200	9,200,708.00	1.96
17	002436	兴森科技	592,400	9,182,200.00	1.95
18	600460	士兰微	290,964	8,807,480.28	1.87

19	688106	金宏气体	298,968	8,131,929.60	1.73
20	688037	芯源微	47,461	8,113,457.95	1.72
21	300666	江丰电子	113,900	7,740,644.00	1.65
22	688153	唯捷创芯	105,776	7,738,572.16	1.64
23	600760	中航沈飞	171,080	7,698,600.00	1.64
24	688475	萤石网络	169,471	7,263,527.06	1.54
25	688300	联瑞新材	151,112	7,064,486.00	1.50
26	688007	光峰科技	330,226	6,885,212.10	1.46
27	300260	新莱应材	172,500	6,817,200.00	1.45
28	300054	鼎龙股份	273,100	6,753,763.00	1.44
29	688425	铁建重工	1,398,128	6,724,995.68	1.43
30	603596	伯特利	84,600	6,705,396.00	1.43
31	301188	力诺特玻	368,500	6,293,980.00	1.34
32	603306	华懋科技	202,000	5,862,040.00	1.25
33	688305	科德数控	56,622	5,676,921.72	1.21
34	688187	时代电气	126,336	5,288,424.96	1.12
35	603100	川仪股份	134,100	5,211,126.00	1.11
36	603197	保隆科技	87,100	4,725,175.00	1.00
37	603931	格林达	148,880	4,533,396.00	0.96
38	000837	秦川机床	276,500	4,501,420.00	0.96
39	688008	澜起科技	75,717	4,347,670.14	0.92
40	002271	东方雨虹	152,000	4,143,520.00	0.88
41	300045	华力创通	345,500	4,007,800.00	0.85
42	688072	拓荆科技	10,000	3,870,200.00	0.82
43	300285	国瓷材料	136,600	3,742,840.00	0.80
44	688433	华曙高科	108,474	3,687,153.50	0.78
45	601208	东材科技	284,450	3,612,515.00	0.77
46	300161	华中数控	63,900	3,419,928.00	0.73
47	688082	盛美上海	28,804	3,179,961.60	0.68
48	603171	税友股份	68,300	2,730,634.00	0.58
49	301039	中集车辆	200,000	2,448,000.00	0.52
50	000888	峨眉山 A	68,800	788,448.00	0.17
51	688582	芯动联科	5,215	241,102.01	0.05
52	301486	致尚科技	3,418	197,081.88	0.04
53	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
54	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
55	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
56	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
57	688249	晶合集成	2,654	47,931.24	0.01
58	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
59	688443	智翔金泰	988	29,136.12	0.01
60	301301	川宁生物	3,199	28,663.04	0.01
61	688361	中科飞测	432	27,937.44	0.01

62	688469	中芯集成	5,003	27,066.23	0.01
63	301325	曼恩斯特	246	26,555.70	0.01
64	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
65	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
66	301358	湖南裕能	466	19,986.74	0.00
67	688531	日联科技	139	18,899.83	0.00
68	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
69	688543	国科军工	342	18,143.10	0.00
70	301307	美利信	536	17,076.96	0.00
71	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
72	688458	美芯晟	181	16,427.56	0.00
73	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
74	301408	华人健康	863	14,627.85	0.00
75	688146	中船特气	382	14,565.66	0.00
76	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
77	301246	宏源药业	472	14,495.12	0.00
78	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
79	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
80	688352	颀中科技	1,189	14,351.23	0.00
81	301332	德尔玛	1,021	14,018.33	0.00
82	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
83	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
84	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
85	001287	中电港	572	12,023.44	0.00
86	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
87	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
88	301322	绿通科技	203	10,807.72	0.00
89	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
90	688479	友车科技	327	9,643.23	0.00
91	601061	中信金属	1,262	9,565.96	0.00
92	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
93	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
94	301439	泓淋电力	528	8,923.20	0.00
95	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
96	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
97	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
98	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
99	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
100	603135	中重科技	423	7,567.47	0.00
101	301345	涛涛车业	156	7,275.84	0.00
102	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
103	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
104	601065	江盐集团	489	5,789.76	0.00

105	601133	柏诚股份	453	5,553.78	0.00
106	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
107	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
108	603125	常青科技	148	3,630.44	0.00
109	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
110	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
111	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
112	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	002044	美年健康	17,693,060.00	4.95
2	300750	宁德时代	17,045,642.00	4.76
3	688220	翱捷科技	15,353,819.04	4.29
4	300567	精测电子	13,787,485.00	3.85
5	688425	铁建重工	11,566,540.62	3.23
6	688037	芯源微	11,144,798.53	3.11
7	300054	鼎龙股份	10,342,430.00	2.89
8	688120	华海清科	9,612,563.67	2.69
9	603197	保隆科技	9,231,528.00	2.58
10	300260	新莱应材	9,096,342.00	2.54
11	003035	南网能源	8,985,000.00	2.51
12	688475	萤石网络	8,756,625.09	2.45
13	600066	宇通客车	8,659,593.00	2.42
14	002436	兴森科技	8,478,349.48	2.37
15	688106	金宏气体	8,170,781.60	2.28
16	688521	芯原股份	7,815,951.75	2.18
17	300666	江丰电子	7,712,215.00	2.16
18	688019	安集科技	7,406,184.58	2.07
19	600760	中航沈飞	7,388,466.00	2.07
20	688153	唯捷创芯	7,317,965.39	2.05
21	002352	顺丰控股	7,206,635.30	2.01

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	002472	双环传动	17,927,802.61	5.01
2	300207	欣旺达	15,055,678.46	4.21
3	002536	飞龙股份	10,454,483.00	2.92

4	688499	利元亨	10,132,398.82	2.83
5	688326	经纬恒润	10,012,535.24	2.80
6	688082	盛美上海	8,729,419.61	2.44
7	600150	中国船舶	8,545,184.00	2.39
8	600460	士兰微	8,147,472.23	2.28
9	688297	中无人机	8,043,149.50	2.25
10	003035	南网能源	8,002,619.00	2.24
11	300627	华测导航	7,833,175.88	2.19
12	600562	国睿科技	7,799,590.00	2.18
13	603171	税友股份	7,792,334.50	2.18
14	688116	天奈科技	7,770,816.58	2.17
15	601208	东材科技	7,667,266.00	2.14
16	002881	美格智能	7,367,000.00	2.06
17	688037	芯源微	7,011,947.71	1.96
18	603197	保隆科技	7,002,726.00	1.96
19	688112	鼎阳科技	6,390,109.92	1.79
20	301328	维峰电子	6,248,071.45	1.75

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	396,168,544.01
卖出股票收入（成交）总额	358,862,122.30

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	66,081.03
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	443,496.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	509,577.06

### 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	689009	九号公司	5,119,500.00	1.09	大宗交易流通受限

### 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 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
18,149	15,765.02	13,427,484.56	4.69	272,691,809.87	95.31

### 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	14,960,398.15	5.228727

### 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2008 年 10 月 22 日) 基金份额总额	273,077,492.69
本报告期期初基金份额总额	258,445,396.43
本报告期基金总申购份额	67,285,274.02
减：本报告期基金总赎回份额	39,611,376.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	286,119,294.43

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

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 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 (%)	
国海证券股份有限公司	1	94,198,151.68	12.77	87,727.17	12.76	-
中信证券股份有限公司	3	77,563,279.75	10.51	72,274.28	10.51	-
中信建投证券股份有限公司	3	75,461,893.49	10.23	70,447.24	10.25	-
中国国际金融股份有限公司	2	70,137,553.47	9.50	65,319.82	9.50	-
中银国际证券股份有限公司	1	51,247,762.47	6.94	47,744.18	6.94	-
民生证券股份有限公司	1	50,501,964.68	6.84	47,035.34	6.84	-
华西证券股份有限公司	1	46,747,349.11	6.34	43,555.90	6.33	-
开源证券股份有限公司	2	39,517,482.81	5.36	36,802.55	5.35	本期新增
安信证券股份有限公司	1	27,024,272.42	3.66	25,167.86	3.66	-
华创证券有限责任公司	1	22,415,694.10	3.04	20,876.09	3.04	-
天风证券股份有限公司	1	21,325,183.86	2.89	19,860.18	2.89	-
国泰君安证券股份有限公司	1	19,787,959.07	2.68	18,479.20	2.69	-

司							
方正证券股份有限公司	2	19,103,337.50	2.59	17,815.23	2.59	-	
中航证券股份有限公司	2	16,210,363.53	2.20	15,096.74	2.20	-	
兴业证券股份有限公司	1	14,583,302.17	1.98	13,581.55	1.98	-	
东方证券股份有限公司	3	14,396,209.92	1.95	13,407.24	1.95	-	
第一创业证券股份有限公司	1	13,991,794.29	1.90	13,030.63	1.90	-	
申万宏源证券有限公司	1	11,618,113.73	1.57	10,820.27	1.57	-	
东方财富证券股份有限公司	2	11,289,487.05	1.53	10,514.13	1.53	-	
太平洋证券股份有限公司	1	10,875,154.96	1.47	10,128.02	1.47	-	
国金证券股份有限公司	1	10,317,574.72	1.40	9,608.35	1.40	-	
长城证券股份有限公司	1	6,892,227.40	0.93	6,449.95	0.94	-	
东亚前海证券有限责任公司	1	5,572,883.45	0.76	5,190.13	0.75	-	
中邮证券股份有限公司	1	2,857,904.96	0.39	2,661.54	0.39	本期新增	
光大证券股份有限公司	2	2,246,010.17	0.30	2,091.76	0.30	本期新增	
中国银河证券股份有限公司	1	2,037,444.89	0.28	1,897.60	0.28	-	
高盛（中国）证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-	
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-	
国都证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期新增 1 个	
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-	
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	
瑞信证券（中国）有限公司	2	-	-	-	-	-	
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-	
申港证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	
招商证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-	
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近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 (%)
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券股份有限公司	1,924,332.48	100.00	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公	-	-	-	-	-	-

司						
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中邮证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞信证券（中国）有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城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
2	景顺长城公司治理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
3	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
4	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
5	关于旗下部分基金新增泰隆银行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 3 月 23 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 3 月 25 日
7	景顺长城公司治理混合型证券投资基金	中国证监会指定报刊及	2023 年 3 月 28 日

	金 2022 年年度报告	网站	
8	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
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增青岛银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 7 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 8 日
11	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
12	景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
13	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
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 22 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 6 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 13 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增德邦证券为销售机构并开通基金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 5 月 26 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 27 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 6 月 10 日
20	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 6 月 16 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 6 月 17 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 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公司治理股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城公司治理混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城公司治理混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城公司治理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