

景顺长城量化成长演化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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

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 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
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 .....	51
7.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	52
<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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
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 .....	55
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城量化成长演化混合
基金主代码	009992
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 11 月 18 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	269,898,246.51 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。本基金注重对中国经济演化趋势的研究，在本基金界定的成长演化主题范围内，通过量化多因子模型精选股票，力争获取行业成长红利和个股超额收益。
投资策略	<p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金依据宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，重点关注包括 GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，形成资产配置方案。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>1、成长演化主题的界定</p> <p>本基金所定义的“成长演化”投资主题，“成长”指未来发展潜力较大，且成长性可持续的行业，“演化”指符合中国经济演化趋势的行业。本基金在兼顾“成长”和“演化”两方面考察标准的情况下，筛选出符合相关标准的行业。</p> <p>2、行业配置策略</p> <p>成长演化主题的各个行业之间的配置，主要通过分析行业的流动性、市值、景气度、宏观周期所处阶段、估值和盈利趋势等方面，综合评估后进行权重配置和动态调整。</p> <p>3、个股投资策略</p> <p>在本基金界定的成长演化主题范围内，本基金主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况的研究，结合宏观经济模型（MEM），采</p>

	<p>取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券类的资产配置。</p> <p>（四）资产支持证券投资策略</p> <p>基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>（五）股指期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>（六）国债期货投资策略</p> <p>本基金可基于谨慎原则，将根据风险管理的原则，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。</p> <p>（七）股票期权投资策略</p> <p>本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p>（八）融资策略</p> <p>本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，对冲系统性风险，实现保值和锁定收益。</p> <p>（九）现金管理策略</p> <p>出于对流动性、有效利用基金资产的考量，本基金适时对各类现金管理工具进行投资。本基金主要通过协议存款、剩余期限一年以内的债券、货币市场工具及债券回购等方式进行现金管理。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%
风险收益特征	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。

### 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	交通银行股份有限公司
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	95559
传真	0755-22381339	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518048	200336
法定代表人	李进	任德奇

## 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	6,027,219.14
本期利润	4,922,999.40
加权平均基金份额本期利润	0.0177
本期加权平均净值利润率	2.10%
本期基金份额净值增长率	2.02%
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	-47,458,855.64
期末可供分配基金份额利润	-0.1758
期末基金资产净值	222,439,390.87
期末基金份额净值	0.8241
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	-17.59%

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	0.82%	0.83%	0.62%	0.69%	0.20%	0.14%
过去三个月	-3.90%	0.78%	-3.82%	0.64%	-0.08%	0.14%
过去六个月	2.02%	0.82%	0.62%	0.64%	1.40%	0.18%
过去一年	-7.27%	0.96%	-9.29%	0.75%	2.02%	0.21%
自基金合同生效起至今	-17.59%	1.13%	-12.01%	0.88%	-5.58%	0.25%

### 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

景顺长城量化成长演化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：本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%，其中投资于本基金界定的“成长演化”主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。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 2020 年 11 月 18 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合均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		
徐 喻 军	本基金的基金经理	2022 年 2 月 19 日	-	13 年	理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员，自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 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、《景顺长城量化成长演化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

2023 年上半年，国内经济整体呈现出弱复苏的态势，服务业的复苏较为明显，制造业和地产的复苏仍需观察，权益市场的表现也反映了较弱的经济和基本面预期。从国内来看，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 49.2、48.8、49.0，今年前 5 个月工业增加值累计同比增长 3.6%，其中 5 月份工业增加值当月同比增长 3.5%，经济复苏的节奏出现放缓的迹象。6 月 PPI 同比下降 5.4%，环比下降 0.8%；CPI 同比持平，环比下降 0.2%，通胀依旧温和。6 月 M2 同比增长 11.3%，M1 同比增速 3.1%，流动性充裕；6 月末外汇储备 3.19 万亿美元，汇率短期承压。整体而言，国内货币政策总体保持稳健，流动性充裕，宏观环境总体温，经济依然是弱复苏的态势。上半年 A 股市场呈现出先涨后跌的态势，风格上来看，价值风格优于成长风格。综合来看，上半年上证指数上涨 3.65%、沪深 300 指数下跌 0.75%，创业板指数下跌 5.61%。

#### 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 2.02%，业绩比较基准收益率为 0.62%。

### 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 2023 年下半年，海外方面，通胀大概率继续回落，美联储的货币政策依然是市场关注的热点，但其对国内资本市场的边际影响明显降低。国内方面，“稳增长”政策有望加快落地，或可对经济形成一定支撑，下半年货币政策预期维持宽松，预期流动性保持合理充裕。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

本基金注重对中国经济演化趋势的研究，密切跟踪我国的产业政策，重点配置新产业政策受益较大的子行业，优先选取行业增长较快且有较大的成长空间的行业进行配置。在本基金界定的成长演化主题范围内，通过量化多因子模型精选股票，力争获取行业成长红利和个股超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

基金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合规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，景顺长城基金管理有限公司在景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，由景顺长城基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：景顺长城量化成长演化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	19,625,585.44	19,099,199.70
结算备付金		764,040.14	785,571.82
存出保证金		35,527.84	37,003.52
交易性金融资产	6.4.7.2	202,967,367.12	211,473,352.92
其中：股票投资		202,950,735.63	211,473,352.92
基金投资		-	-
债券投资		16,631.49	-
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		121,109.75	298,296.33
应收股利		-	-
应收申购款		3,045.77	4,908.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		223,516,676.06	231,698,332.34
<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		-	-
应付赎回款		128,522.15	81,028.18
应付管理人报酬		275,953.93	296,020.06
应付托管费		45,992.33	49,336.69
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	626,816.78	539,185.08
负债合计		1,077,285.19	965,570.01
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	269,898,246.51	285,611,821.35
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-47,458,855.64	-54,879,059.02
净资产合计		222,439,390.87	230,732,762.33
负债和净资产总计		223,516,676.06	231,698,332.34

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8241 元，基金份额总额 269,898,246.51 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化成长演化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>		7,056,755.03	-43,875,158.12
1. 利息收入		31,943.56	36,556.29
其中：存款利息收入	6.4.7.13	31,943.56	36,556.29
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）		8,126,839.74	-48,082,876.25
其中：股票投资收益	6.4.7.14	5,530,668.95	-50,520,739.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	51,241.48	73,289.55
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	2,544,929.31	2,364,573.50
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	-1,104,219.74	4,160,736.77
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	2,191.47	10,425.07
<b>减：二、营业总支出</b>		2,133,755.63	2,444,248.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,746,816.83	2,006,171.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	291,136.16	334,361.81
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		0.08	0.04
8. 其他费用	6.4.7.23	95,802.56	103,715.79

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,922,999.40	-46,319,406.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,922,999.40	-46,319,406.95
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,922,999.40	-46,319,406.95

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城量化成长演化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）	285,611,821.35	-	-54,879,059.02	230,732,762.33
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）	285,611,821.35	-	-54,879,059.02	230,732,762.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,713,574.84	-	7,420,203.38	-8,293,371.46
（一）、综合收益总额	-	-	4,922,999.40	4,922,999.40
（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）	-15,713,574.84	-	2,497,203.98	-13,216,370.86
其中：1. 基金申购款	1,738,798.47	-	-274,150.09	1,464,648.38
2. 基金赎回款	-17,452,373.31	-	2,771,354.07	-14,681,019.24
（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)	269,898,246.51	-	-47,458,855.64	222,439,390.87
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)	319,073,467.80	-	10,825,583.12	329,899,050.92
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)	319,073,467.80	-	10,825,583.12	329,899,050.92
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-18,380,861.67	-	-44,268,232.89	-62,649,094.56
(一)、综合收益总额	-	-	-46,319,406.95	-46,319,406.95
(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)	-18,380,861.67	-	2,051,174.06	-16,329,687.61
其中: 1. 基金申购款	6,374,355.76	-	-752,113.83	5,622,241.93
2. 基金赎回款	-24,755,217.43	-	2,803,287.89	-21,951,929.54
(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)	300,692,606.13	-	-33,442,649.77	267,249,956.36

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

景顺长城量化成长演化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[2020]1620号《关于准予景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金注册的批复》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《景顺长城量化成长演化混合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 1,147,379,251.65 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0968 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,147,713,112.19 份基金份额,其中认购资金利息折合 333,860.54 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化成长演化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(包含主板、中小板、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)、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、定期存款及其他银行存款)、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)。本基金可以根据法律法规的规定参与融资业务。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%,其中投资于本基金界定的“成长演化”主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。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、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×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	19,625,585.44
等于：本金	19,624,708.94
加：应计利息	876.50
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	19,625,585.44

##### 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	207,215,873.00	-	202,950,735.63	-4,265,137.37	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	12,000.00	7.89	16,631.49	4,623.60
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,000.00	7.89	16,631.49	4,623.60
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	207,227,873.00	7.89	202,967,367.12	-4,260,513.77	

##### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	488,014.22
其中：交易所市场	488,014.22
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	138,802.56
合计	626,816.78

#### 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	285,611,821.35	285,611,821.35
本期申购	1,738,798.47	1,738,798.47
本期赎回（以“-”号填列）	-17,452,373.31	-17,452,373.31
本期末	269,898,246.51	269,898,246.51

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	-30,755,804.87	-24,123,254.15	-54,879,059.02
本期利润	6,027,219.14	-1,104,219.74	4,922,999.40
本期基金份额交易产生的变动数	1,361,047.05	1,136,156.93	2,497,203.98
其中：基金申购款	-152,364.43	-121,785.66	-274,150.09
基金赎回款	1,513,411.48	1,257,942.59	2,771,354.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,367,538.68	-24,091,316.96	-47,458,855.64

#### 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
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	7,314.65

其他	332.68
合计	31,943.56

#### 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	5,530,668.95
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	5,530,668.95

##### 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	627,538,391.77
减：卖出股票成本总额	620,131,180.11
减：交易费用	1,876,542.71
买卖股票差价收入	5,530,668.95

##### 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	34.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	51,206.85
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	51,241.48

##### 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	283,245.62

额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	232,000.00
减：应计利息总额	27.46
减：交易费用	11.31
买卖债券差价收入	51,206.85

#### 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	2,544,929.31
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	2,544,929.31

#### 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	-1,104,219.74
股票投资	-1,108,843.34

债券投资	4,623.60
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	-1,104,219.74

#### 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	2,168.64
基金转换费收入	22.83
合计	2,191.47

#### 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	24,795.19
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	2,500.00
合计	95,802.56

### 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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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

无。

## 6.4.10.1.2 权证交易

无。

## 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

## 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	1,746,816.83	2,006,171.19
其中：支付销售机构的客户维护费	673,208.51	773,242.26

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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托管费	291,136.16	334,361.81

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期	19,625,585.44	24,296.23	20,513,315.82	29,303.71

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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	331	3,932.28	6,957.62	-
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	100	2,068.00	2,549.00	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	144	2,214.72	2,141.28	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	49	2,179.52	1,934.52	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	28.84	30.78	142	4,095.28	4,370.76	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	198	8,157.60	8,452.62	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	120	6,780.00	6,351.60	-
301202	朗威股	2023年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	25.82	25.82	1,844	47,612.08	47,612.08	-

	份	日								
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	205	5,293.10	5,293.10	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	176	8,118.88	6,054.40	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	120	8,700.00	7,010.40	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	286	14,300.00	8,783.06	-
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	1,395	51,475.50	51,475.50	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	155	5,719.50	5,719.50	-
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	3,773	75,422.27	75,422.27	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	420	8,395.80	8,395.80	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	263	7,784.80	18,783.46	-
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	1,975	9,875.00	17,696.00	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	312	10,090.08	9,940.32	-

		日								
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	201	6,490.29	10,275.12	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	577	11,926.59	15,100.09	-
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	81	10,619.91	4,312.44	-
301322	绿通科技	2023年5月25日	1-6个月(含)	新股流通受限	-	53.24	40	-	2,129.60	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	151	5,898.06	5,943.36	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	137	10,521.60	14,789.15	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	538	7,967.78	7,386.74	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	186	6,063.60	5,648.82	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	93	6,830.85	4,337.52	-
301355	南王科	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	420	7,371.00	7,035.00	-

	技	日								
301357	北方 方长 龙	2023 年4 月11 日	6个月	新股 流通 受限	50.00	48.39	149	7,450.00	7,210.11	-
301358	湖南 裕能	2023 年2 月1 日	6个月	新股 流通 受限	23.77	42.89	298	7,083.46	12,781.22	-
301360	荣旗 科技	2023 年4 月17 日	6个月	新股 流通 受限	71.88	92.60	104	7,475.52	9,630.40	-
301373	凌玮 科技	2023 年1 月20 日	6个月	新股 流通 受限	33.73	31.85	215	7,251.95	6,847.75	-
301386	未来 电器	2023 年3 月21 日	6个月	新股 流通 受限	29.99	23.79	248	7,437.52	5,899.92	-
301397	溯联 股份	2023 年6 月15 日	6个月	新股 流通 受限	53.27	40.20	175	9,322.25	7,035.00	-
301408	华人 健康	2023 年2 月22 日	6个月	新股 流通 受限	16.24	16.95	505	8,201.20	8,559.75	-
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	320	6,396.80	5,408.00	-
301486	致尚 科	2023 年6 月30	1个月 内(含)	新股 流通 受限	57.66	57.66	1,498	86,374.68	86,374.68	-

	技	日								
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	167	9,629.22	9,629.22	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	728	4,790.24	5,518.24	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	279	2,890.44	3,303.36	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	258	3,008.28	3,163.08	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	86	2,234.28	2,109.58	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	243	4,325.40	4,347.27	-
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	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	219	7,916.85	8,350.47	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	1,481	29,412.66	26,746.86	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	463	6,556.08	7,505.23	-
688352	顾中科	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	693	8,385.30	8,364.51	-

	技	日									
688361	中科 飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	23.60	64.67	230	5,428.00	14,874.10	-	
688429	时创 能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股 流通 受限	19.20	25.53	273	5,241.60	6,969.69	-	
688433	华曙 高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股 流通 受限	26.66	31.50	224	5,971.84	7,056.00	-	
688443	智翔 金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股 流通 受限	37.88	29.49	486	18,409.68	14,332.14	-	
688458	美芯 晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	75.00	90.76	94	7,050.00	8,531.44	-	
688469	中芯 集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	5.69	5.41	2,781	15,823.89	15,045.21	-	
688472	阿特 斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	11.10	17.04	967	10,733.70	16,477.68	-	
688478	晶升 股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股 流通 受限	32.52	42.37	261	8,487.72	11,058.57	-	
688479	友车 科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股 流通 受限	33.99	29.49	177	6,016.23	5,219.73	-	
688502	茂莱 光学	2023 年 2 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	69.72	178.59	1,063	74,112.36	189,841.17	-	
688531	日联 科	2023 年 3 月 24	6 个月	新股 流通 受限	152.38	135.97	81	12,342.78	11,013.57	-	

	技	日								
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	150	5,250.00	7,684.50	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	164	7,161.88	8,700.20	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	497	6,301.96	11,088.07	-
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股流通受限	135.80	120.41	92	12,493.60	11,077.72	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	253	6,765.22	10,292.04	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	581	6,495.58	8,476.79	-
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	1,125	61,875.00	61,875.00	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	126	6,930.00	6,930.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	687	7,337.16	8,477.58	-
688623	二元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	68	8,559.84	5,901.72	-
688629	华丰科	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	617	5,713.42	11,470.03	-

	技	日								
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	184	4,651.52	5,496.08	-

#### 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 0.01%（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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日内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 个工作日内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	19,625,585.44	-	-	-	-	-	19,625,585.44
结算备付金	764,040.14	-	-	-	-	-	764,040.14
存出保证金	35,527.84	-	-	-	-	-	35,527.84
交易性金融资产	-	-	-	-	16,631.49	202,950,735.63	202,967,367.12

应收申购款	-	-	-	-	-	3,045.77	3,045.77
应收证券清算款	-	-	-	-	-	121,109.75	121,109.75
资产总计	20,425,153.42	-	-	-16,631.49	203,074,891.15	223,516,676.06	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	128,522.15	128,522.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	275,953.93	275,953.93
应付托管费	-	-	-	-	-	45,992.33	45,992.33
其他负债	-	-	-	-	-	626,816.78	626,816.78
负债总计	-	-	-	-	-	1,077,285.19	1,077,285.19
利率敏感度缺口	20,425,153.42	-	-	-16,631.49	-	-	-
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	19,099,199.70	-	-	-	-	-	19,099,199.70
结算备付金	785,571.82	-	-	-	-	-	785,571.82
存出保证金	37,003.52	-	-	-	-	-	37,003.52
交易性金融资产	-	-	-	-	-211,473,352.92	-	211,473,352.92
应收申购款	-	-	-	-	-	4,908.05	4,908.05
应收证券清算款	-	-	-	-	-	298,296.33	298,296.33
资产总计	19,921,775.04	-	-	-	-211,776,557.30	231,698,332.34	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	81,028.18	81,028.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	296,020.06	296,020.06
应付托管费	-	-	-	-	-	49,336.69	49,336.69
其他负债	-	-	-	-	-	539,185.08	539,185.08
负债总计	-	-	-	-	-	965,570.01	965,570.01
利率敏感度缺口	19,921,775.04	-	-	-	-	-	-

#### 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 0.01%（上年度末：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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	202,950,735.63	91.24	211,473,352.92	91.65
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	202,950,735.63	91.24	211,473,352.92	91.65

#### 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%	8,925,789.64	9,257,009.02
	沪深 300 指数下降 5%	-8,925,789.64	-9,257,009.02

### 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	201,834,018.99	210,761,096.26
第二层次	376,423.15	-
第三层次	756,924.98	712,256.66
合计	202,967,367.12	211,473,352.92

##### 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和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券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	202,950,735.63	90.80
	其中：股票	202,950,735.63	90.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,631.49	0.01
	其中：债券	16,631.49	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,389,625.58	9.12
8	其他各项资产	159,683.36	0.07
9	合计	223,516,676.06	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	259,740.00	0.12
C	制造业	146,926,401.74	66.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	553,442.47	0.25
E	建筑业	1,599,691.59	0.72
F	批发和零售业	3,543,922.57	1.59
G	交通运输、仓储和邮政业	248,688.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,020,802.21	6.30
J	金融业	28,744,970.00	12.92
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	258,602.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	3,609,463.59	1.62
N	水利、环境和公共设施管理业	517,002.40	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,668,009.06	1.20
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	202,950,735.63	91.24

## 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	601318	中国平安	248,451	11,528,126.40	5.18
2	600519	贵州茅台	5,800	9,807,800.00	4.41
3	000725	京东方 A	1,808,400	7,396,356.00	3.33
4	000858	五粮液	44,700	7,311,579.00	3.29
5	601377	兴业证券	998,750	6,112,350.00	2.75
6	600887	伊利股份	214,600	6,077,472.00	2.73
7	002422	科伦药业	196,000	5,817,280.00	2.62
8	002049	紫光国微	60,380	5,630,435.00	2.53
9	002402	和而泰	304,000	5,161,920.00	2.32
10	601688	华泰证券	370,300	5,099,031.00	2.29
11	600161	天坛生物	181,700	4,933,155.00	2.22
12	002223	鱼跃医疗	114,200	4,110,058.00	1.85
13	688981	中芯国际	77,300	3,905,196.00	1.76
14	002065	东华软件	548,300	3,870,998.00	1.74
15	000997	新大陆	197,600	3,734,640.00	1.68
16	000651	格力电器	97,500	3,559,725.00	1.60
17	600750	江中药业	161,390	3,539,282.70	1.59
18	603259	药明康德	51,456	3,206,223.36	1.44
19	603027	千禾味业	140,200	2,961,024.00	1.33
20	603369	今世缘	55,200	2,914,560.00	1.31
21	601601	中国太保	112,100	2,912,358.00	1.31
22	002384	东山精密	106,012	2,745,710.80	1.23
23	000513	丽珠集团	69,200	2,692,572.00	1.21
24	300015	爱尔眼科	141,232	2,619,853.60	1.18
25	300760	迈瑞医疗	8,500	2,548,300.00	1.15
26	000333	美的集团	41,400	2,439,288.00	1.10
27	603290	斯达半导	11,200	2,410,240.00	1.08
28	603501	韦尔股份	23,300	2,284,332.00	1.03
29	300896	爱美客	5,000	2,224,750.00	1.00
30	000100	TCL 科技	498,300	1,963,302.00	0.88
31	600271	航天信息	137,100	1,876,899.00	0.84
32	300146	汤臣倍健	75,700	1,815,286.00	0.82
33	002373	千方科技	127,200	1,735,008.00	0.78
34	600600	青岛啤酒	16,700	1,730,621.00	0.78
35	600837	海通证券	174,100	1,605,202.00	0.72
36	000733	振华科技	16,600	1,591,110.00	0.72
37	002475	立讯精密	48,600	1,577,070.00	0.71

38	600566	济川药业	52,000	1,510,080.00	0.68
39	002236	大华股份	75,700	1,495,075.00	0.67
40	601607	上海医药	63,300	1,418,553.00	0.64
41	603986	兆易创新	13,000	1,381,250.00	0.62
42	601618	中国中冶	336,000	1,333,920.00	0.60
43	600329	达仁堂	29,600	1,328,744.00	0.60
44	002415	海康威视	37,400	1,238,314.00	0.56
45	688012	中微公司	7,900	1,235,955.00	0.56
46	300223	北京君正	12,600	1,112,706.00	0.50
47	002737	葵花药业	45,400	1,105,036.00	0.50
48	002156	通富微电	47,200	1,066,720.00	0.48
49	688396	华润微	19,959	1,046,051.19	0.47
50	600285	羚锐制药	64,400	1,034,264.00	0.46
51	300009	安科生物	100,000	1,000,000.00	0.45
52	002152	广电运通	84,900	995,028.00	0.45
53	600584	长电科技	31,600	984,972.00	0.44
54	300232	洲明科技	100,000	914,000.00	0.41
55	002600	领益智造	129,800	896,918.00	0.40
56	601336	新华保险	23,900	878,803.00	0.40
57	000739	普洛药业	49,200	872,808.00	0.39
58	600211	西藏药业	14,500	861,300.00	0.39
59	600570	恒生电子	19,372	857,985.88	0.39
60	002371	北方华创	2,700	857,655.00	0.39
61	603156	养元饮品	34,600	854,620.00	0.38
62	603160	汇顶科技	17,900	827,875.00	0.37
63	688008	澜起科技	14,200	815,364.00	0.37
64	688589	力合微	19,600	798,504.00	0.36
65	002185	华天科技	77,600	713,920.00	0.32
66	002139	拓邦股份	51,100	666,855.00	0.30
67	000028	国药一致	15,210	663,308.10	0.30
68	300122	智飞生物	14,950	660,790.00	0.30
69	000999	华润三九	10,700	649,062.00	0.29
70	600998	九州通	60,047	623,287.86	0.28
71	300383	光环新网	56,600	608,450.00	0.27
72	000623	吉林敖东	36,100	579,044.00	0.26
73	002852	道道全	43,100	557,283.00	0.25
74	688508	芯朋微	8,700	504,513.00	0.23
75	600845	宝信软件	9,731	494,432.11	0.22
76	002063	远光软件	55,400	480,872.00	0.22
77	002821	凯莱英	4,060	478,511.60	0.22
78	002436	兴森科技	29,600	458,800.00	0.21
79	600572	康恩贝	65,400	447,990.00	0.20
80	603345	安井食品	3,000	440,400.00	0.20

81	300130	新国都	15,200	430,616.00	0.19
82	002603	以岭药业	15,500	398,195.00	0.18
83	600535	天士力	25,700	372,907.00	0.17
84	300532	今天国际	17,600	361,856.00	0.16
85	600901	江苏金租	84,420	348,654.60	0.16
86	002745	木林森	37,200	342,240.00	0.15
87	002129	TCL 中环	10,200	338,640.00	0.15
88	600438	通威股份	8,900	305,359.00	0.14
89	600511	国药股份	7,700	299,145.00	0.13
90	688630	芯碁微装	3,400	285,668.00	0.13
91	603859	能科科技	5,500	281,215.00	0.13
92	300782	卓胜微	2,900	280,227.00	0.13
93	688080	映翰通	5,720	279,708.00	0.13
94	002536	飞龙股份	18,607	279,105.00	0.13
95	300349	金卡智能	20,100	278,988.00	0.13
96	301039	中集车辆	20,900	276,507.00	0.12
97	603032	德新科技	8,000	276,320.00	0.12
98	605300	佳禾食品	12,600	273,924.00	0.12
99	600066	宇通客车	18,500	272,690.00	0.12
100	301004	嘉益股份	7,000	271,600.00	0.12
101	300951	博硕科技	4,950	270,418.50	0.12
102	600720	祁连山	23,700	269,469.00	0.12
103	688019	安集科技	1,630	268,672.90	0.12
104	300842	帝科股份	2,900	265,176.00	0.12
105	002997	瑞鹄模具	8,900	264,597.00	0.12
106	000921	海信家电	9,800	264,110.00	0.12
107	301268	铭利达	6,300	263,781.00	0.12
108	603298	杭叉集团	11,200	263,760.00	0.12
108	688516	奥特维	1,400	263,760.00	0.12
109	002847	盐津铺子	3,100	263,655.00	0.12
109	603920	世运电路	13,500	263,655.00	0.12
110	688676	金盘科技	8,700	263,523.00	0.12
111	688186	广大特材	8,100	263,493.00	0.12
112	301198	喜悦智行	17,300	262,614.00	0.12
113	603757	大元泵业	8,800	262,592.00	0.12
114	300839	博汇股份	19,740	262,344.60	0.12
115	000408	藏格矿业	11,600	261,812.00	0.12
116	300633	开立医疗	4,800	261,600.00	0.12
117	600312	平高电气	21,100	261,429.00	0.12
118	002033	丽江股份	24,000	261,120.00	0.12
119	003006	百亚股份	15,100	260,928.00	0.12
120	688305	科德数控	2,600	260,676.00	0.12
121	000155	川能动力	18,100	260,640.00	0.12

122	601528	瑞丰银行	53,700	260,445.00	0.12
123	688556	高测股份	4,900	260,386.00	0.12
124	300811	铂科新材	4,380	260,347.20	0.12
125	600820	隧道股份	43,300	260,233.00	0.12
126	605266	健之佳	3,100	259,873.00	0.12
127	600583	海油工程	44,400	259,740.00	0.12
128	003000	劲仔食品	20,600	259,354.00	0.12
129	605009	豪悦护理	5,400	259,200.00	0.12
130	603129	春风动力	1,600	259,040.00	0.12
131	002727	一心堂	9,800	258,720.00	0.12
132	600481	双良节能	18,500	258,630.00	0.12
133	300795	米奥会展	6,200	258,602.00	0.12
134	603605	珀莱雅	2,300	258,520.00	0.12
135	301101	明月镜片	6,300	258,489.00	0.12
136	600674	川投能源	17,100	257,355.00	0.12
137	600129	太极集团	4,300	255,807.00	0.12
138	688599	天合光能	6,000	255,660.00	0.11
139	603197	保隆科技	4,700	254,975.00	0.11
140	600419	天润乳业	15,700	254,654.00	0.11
141	300396	迪瑞医疗	7,800	253,422.00	0.11
142	688390	固德威	1,500	250,290.00	0.11
143	688120	华海清科	992	250,033.60	0.11
144	000888	峨眉山A	21,800	249,828.00	0.11
145	601333	广深铁路	62,800	248,688.00	0.11
146	002959	小熊电器	2,900	242,150.00	0.11
147	000021	深科技	11,900	237,881.00	0.11
148	688126	沪硅产业	10,200	213,180.00	0.10
149	600060	海信视像	8,600	212,850.00	0.10
150	600050	中国联通	40,500	194,400.00	0.09
151	688502	茂莱光学	1,063	189,841.17	0.09
152	002885	京泉华	7,400	161,616.00	0.07
153	002507	涪陵榨菜	8,150	149,226.50	0.07
154	603127	昭衍新药	2,800	114,520.00	0.05
155	600196	复星医药	3,500	108,150.00	0.05
156	000534	万泽股份	5,900	98,943.00	0.04
157	301486	致尚科技	1,665	96,003.90	0.04
158	600809	山西汾酒	500	92,535.00	0.04
159	002273	水晶光电	7,700	91,938.00	0.04
160	301292	海科新源	4,193	83,818.07	0.04
161	002429	兆驰股份	14,100	77,550.00	0.03
162	688603	天承科技	1,251	68,805.00	0.03
163	301261	恒工精密	1,550	57,195.00	0.03
164	603383	顶点软件	1,000	55,420.00	0.02

165	301202	朗威股份	2,049	52,905.18	0.02
166	600745	闻泰科技	1,000	48,900.00	0.02
167	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
168	301103	何氏眼科	700	29,372.00	0.01
169	688249	晶合集成	1,481	26,746.86	0.01
170	301293	三博脑科	263	18,783.46	0.01
171	301301	川宁生物	1,975	17,696.00	0.01
172	688472	阿特斯	967	16,477.68	0.01
173	301317	鑫磊股份	577	15,100.09	0.01
174	688469	中芯集成	2,781	15,045.21	0.01
175	688361	中科飞测	230	14,874.10	0.01
176	301325	曼恩斯特	137	14,789.15	0.01
177	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.01
178	688443	智翔金泰	486	14,332.14	0.01
179	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.01
180	301358	湖南裕能	298	12,781.22	0.01
181	688629	华丰科技	617	11,470.03	0.01
182	688562	航天软件	497	11,088.07	0.00
183	688576	西山科技	92	11,077.72	0.00
184	688478	晶升股份	261	11,058.57	0.00
185	688531	日联科技	81	11,013.57	0.00
186	688582	芯动联科	253	10,292.04	0.00
187	301315	威士顿	201	10,275.12	0.00
188	301307	美利信	312	9,940.32	0.00
189	600183	生益科技	700	9,940.00	0.00
190	301360	荣旗科技	104	9,630.40	0.00
191	301246	宏源药业	286	8,783.06	0.00
192	688543	国科军工	164	8,700.20	0.00
193	301408	华人健康	505	8,559.75	0.00
194	688458	美芯晟	94	8,531.44	0.00
195	688620	安凯微	687	8,477.58	0.00
196	688593	新相微	581	8,476.79	0.00
197	301141	中科磁业	198	8,452.62	0.00
198	688352	颀中科技	693	8,364.51	0.00
199	688146	中船特气	219	8,350.47	0.00
200	688535	华海诚科	150	7,684.50	0.00
201	688334	西高院	463	7,505.23	0.00
202	301332	德尔玛	538	7,386.74	0.00
203	301357	北方长龙	149	7,210.11	0.00
204	688433	华曙高科	224	7,056.00	0.00
205	301355	南王科技	420	7,035.00	0.00
205	301397	溯联股份	175	7,035.00	0.00
206	301232	飞沃科技	120	7,010.40	0.00

207	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
208	688429	时创能源	273	6,969.69	0.00
209	001287	中电港	331	6,957.62	0.00
210	301373	凌玮科技	215	6,847.75	0.00
211	301322	绿通科技	121	6,442.04	0.00
212	301157	华塑科技	120	6,351.60	0.00
213	301203	国泰环保	176	6,054.40	0.00
214	301323	新莱福	151	5,943.36	0.00
215	688623	二元科技	68	5,901.72	0.00
216	301386	未来电器	248	5,899.92	0.00
217	301337	亚华电子	186	5,648.82	0.00
218	601061	中信金属	728	5,518.24	0.00
219	688631	莱斯信息	184	5,496.08	0.00
220	301439	泓淋电力	320	5,408.00	0.00
221	688479	友车科技	177	5,219.73	0.00
222	001380	华纬科技	142	4,370.76	0.00
223	603135	中重科技	243	4,347.27	0.00
224	301345	涛涛车业	93	4,337.52	0.00
225	601065	江盐集团	279	3,303.36	0.00
226	601133	柏诚股份	258	3,163.08	0.00
227	001328	登康口腔	100	2,549.00	0.00
228	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
229	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
230	001360	南矿集团	144	2,141.28	0.00
231	603125	常青科技	86	2,109.58	0.00
232	001367	海森药业	49	1,934.52	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	000725	京东方 A	11,005,983.00	4.77
2	601688	华泰证券	10,891,674.00	4.72
3	600535	天士力	10,837,753.54	4.70
4	603290	斯达半导	8,989,577.00	3.90
5	600519	贵州茅台	8,672,772.06	3.76
6	000513	丽珠集团	8,609,868.00	3.73
7	002475	立讯精密	8,311,455.00	3.60
8	000858	五粮液	8,292,101.00	3.59
9	600887	伊利股份	8,169,884.00	3.54
10	000895	双汇发展	7,920,695.00	3.43
11	600298	安琪酵母	7,497,077.00	3.25
12	002273	水晶光电	7,308,302.10	3.17

13	300015	爱尔眼科	7,167,658.47	3.11
14	600750	江中药业	7,095,827.30	3.08
15	000538	云南白药	6,957,546.60	3.02
16	600584	长电科技	6,905,945.00	2.99
17	000776	广发证券	6,628,937.00	2.87
18	601336	新华保险	6,611,025.34	2.87
19	601377	兴业证券	6,563,733.50	2.84
20	688396	华润微	6,477,347.70	2.81
21	002422	科伦药业	6,281,640.00	2.72
22	600901	江苏金租	5,710,030.00	2.47
23	600566	济川药业	5,526,706.00	2.40
24	002049	紫光国微	5,459,509.98	2.37
25	300896	爱美客	5,398,231.00	2.34
26	002938	鹏鼎控股	5,394,720.00	2.34
27	002410	广联达	5,217,427.00	2.26
28	002600	领益智造	5,215,831.00	2.26
29	600837	海通证券	5,184,403.00	2.25
30	000651	格力电器	5,118,747.00	2.22
31	600161	天坛生物	5,080,885.00	2.20
32	600206	有研新材	5,019,221.00	2.18
33	600845	宝信软件	5,014,681.05	2.17
34	600563	法拉电子	5,004,182.88	2.17
35	300009	安科生物	4,980,030.00	2.16
36	002402	和而泰	4,852,722.00	2.10
37	601555	东吴证券	4,846,892.00	2.10
38	000100	TCL 科技	4,740,229.00	2.05

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	002475	立讯精密	11,795,016.90	5.11
2	600535	天士力	11,372,618.64	4.93
3	002938	鹏鼎控股	10,307,061.48	4.47
4	002273	水晶光电	10,190,320.32	4.42
5	000651	格力电器	10,009,009.20	4.34
6	601555	东吴证券	9,806,517.90	4.25
7	603290	斯达半导	9,755,667.00	4.23
8	000568	泸州老窖	9,114,987.80	3.95
9	600584	长电科技	9,092,683.00	3.94
10	300009	安科生物	9,013,174.00	3.91
11	600298	安琪酵母	8,720,219.00	3.78
12	000895	双汇发展	8,620,287.40	3.74

13	601601	中国太保	8,345,331.00	3.62
14	600438	通威股份	8,113,655.00	3.52
15	601336	新华保险	7,576,629.00	3.28
16	000513	丽珠集团	7,402,593.94	3.21
17	601688	华泰证券	7,151,602.00	3.10
18	000538	云南白药	7,069,916.80	3.06
19	600572	康恩贝	6,829,687.00	2.96
20	603259	药明康德	6,753,290.00	2.93
21	600600	青岛啤酒	6,698,931.00	2.90
22	600901	江苏金租	6,543,533.16	2.84
23	300896	爱美客	6,317,100.65	2.74
24	600570	恒生电子	6,271,514.92	2.72
25	002049	紫光国微	6,175,787.00	2.68
26	000776	广发证券	6,077,009.00	2.63
27	000661	长春高新	5,900,039.00	2.56
28	002410	广联达	5,878,682.21	2.55
29	002371	北方华创	5,800,347.00	2.51
30	601231	环旭电子	5,564,830.00	2.41
31	002304	洋河股份	5,559,543.00	2.41
32	600837	海通证券	5,503,546.00	2.39
33	002821	凯莱英	5,332,602.80	2.31
34	603019	中科曙光	5,295,918.00	2.30
35	600809	山西汾酒	5,252,870.00	2.28
36	600563	法拉电子	5,220,231.59	2.26
37	603868	飞科电器	5,133,660.60	2.22
38	688396	华润微	5,126,608.13	2.22
39	300496	中科创达	5,022,711.00	2.18
40	600998	九州通	5,010,959.40	2.17
41	600380	健康元	4,994,380.00	2.16
42	600519	贵州茅台	4,896,704.00	2.12
43	600206	有研新材	4,834,839.00	2.10
44	002600	领益智造	4,729,866.00	2.05
45	600750	江中药业	4,681,513.00	2.03
46	600845	宝信软件	4,646,160.20	2.01

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	612,717,406.16
卖出股票收入（成交）总额	627,538,391.77

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）	16,631.49	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,631.49	0.01

## 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	123195	蓝晓转 02	120	16,631.49	0.01

## 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。再参考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，将根据风险管理的原则，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

中国平安保险（集团）股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

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	35,527.84
2	应收清算款	121,109.75
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,045.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	159,683.36

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
11,955	22,576.18	6,047.13	0.00	269,892,199.38	100.00

## 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	329.88	0.000122

## 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 (2020 年 11 月 18 日) 基金份额总额	1,147,713,112.19
本报告期期初基金份额总额	285,611,821.35
本报告期基金总申购份额	1,738,798.47
减：本报告期基金总赎回份额	17,452,373.31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	269,898,246.51

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**

本基金本报告期末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 (%)	
中信证券股份有限公司	2	934,012,236.81	75.69	869,852.41	75.69	未变更
东吴证券股份有限公司	1	299,992,182.77	24.31	279,380.20	24.31	未变更
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更

公司						
中信建投 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	未变 更

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(%)
中信证券股份有限公司	283,245.62	100.00	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证	-	-	-	-	-	-

券股份 有限公 司						
中信建 投证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 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	景顺长城量化成长演化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	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
6	景顺长城量化成长演化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
7	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
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 4 月 8 日
9	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
10	景顺长城量化成长演化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
11	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
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 22 日
13	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
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 5 月 13 日
15	景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 26 日
16	景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金 2023 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 26 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 5 月 27 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 6 月 10 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海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 14 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量化成长演化混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城量化成长演化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