

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵  
活配置混合型发起式证券投资基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	10
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>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	11
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 .....	11
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 .....	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 .....	14
6.4 报表附注 .....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	39
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 .....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	51

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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.12 市场中性策略执行情况 .....	53
7.13 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	62
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>64</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 .....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录 .....	65
12.2 存放地点 .....	66
12.3 查阅方式 .....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合
基金主代码	008851
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 2 月 27 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	254,622,281.22 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型和绝对收益策略，有效对冲市场系统性风险，追求长期稳定的绝对收益。
投资策略	<p>本基金主要采用量化对冲的投资策略，一方面坚持采用基金管理人自主研发的量化模型构建股票投资组合，另一方面，灵活应用多种绝对收益策略有效对冲本基金的系统性风险，例如做空股指期货进行对冲操作，获取选股的超额收益，追求长期稳定的绝对收益。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金采用灵活配置的投资策略，根据基金所使用对冲工具的年化对冲成本来决定当月股票资产的投资比例，建仓期（6 个月）内不受仓位调整机制的约束，建仓期满的第一个月起（包括第一个月），如基金所使用对冲工具的年化对冲成本达到仓位调整阈值，则触发仓位调整机制。</p> <p>2、对冲策略</p> <p>本基金现阶段主要通过股指期货有效对冲持有股票的系统性风险。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理和风险控制的原则，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金通过对现货和期货市场相关性研究，计算需要的股指期货合约数量，并根据不同期货合约定价关系、保证金要求、流动性情况等因素，对股指期货合约数量及配比进行动态调整，寻求与现货资产的匹配，力争构建市场中性投资组合并获得稳定的正向超额收益。</p> <p>3、套利策略</p> <p>本基金寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉套利和绝对收益机会，以提高资本的利用率，从而达到投资策略的多元化，努力进一步提高绝对收益水平，例如股指期货套利、统计套利、定向增发套利、大宗交易套利、并购套利等。</p>
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期 1 年定期存款基准利率（税后）+1%。
风险收益特征	本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决

	于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。
--	-------------------------------

### 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	郭明
	联系电话	0755-82370388	(010) 66105799
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@icbc.com.cn
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	证券日报
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	5,571,242.86
本期利润	3,621,162.84
加权平均基金份额本期利润	0.0197
本期加权平均净值利润率	1.92%
本期基金份额净值增长率	0.83%
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	7,484,253.69
期末可供分配基金份额利润	0.0294
期末基金资产净值	262,106,534.91
期末基金份额净值	1.0293
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	2.93%

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。

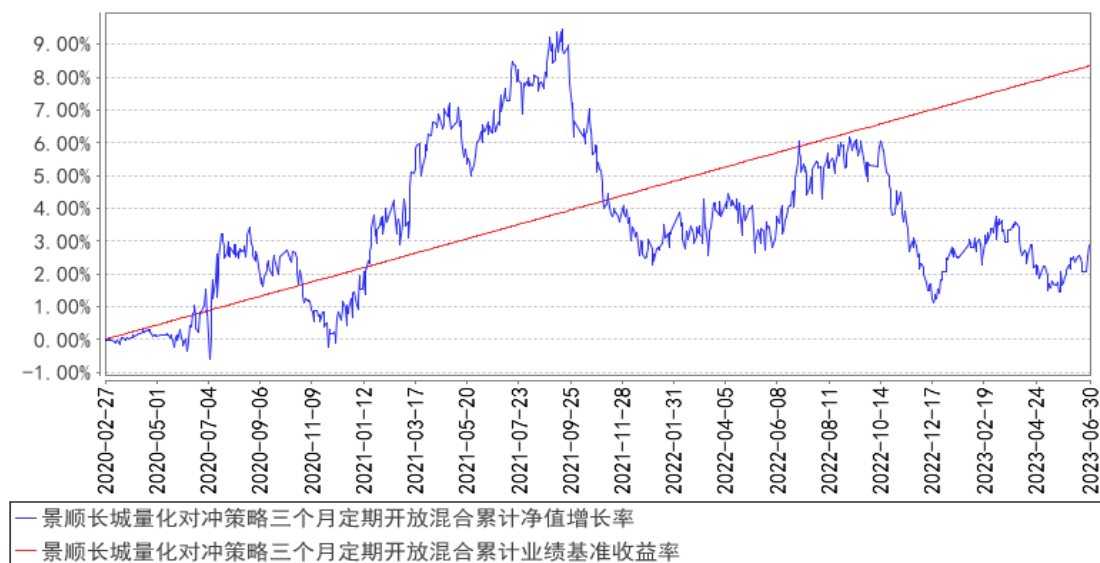
## 3.2 基金净值表现

### 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	0.91%	0.16%	0.19%	0.01%	0.72%	0.15%
过去三个月	-0.61%	0.22%	0.58%	0.01%	-1.19%	0.21%
过去六个月	0.83%	0.23%	1.16%	0.01%	-0.33%	0.22%
过去一年	-1.62%	0.26%	2.36%	0.01%	-3.98%	0.25%
过去三年	1.44%	0.32%	7.43%	0.01%	-5.99%	0.31%
自基金合同生效起至今	2.93%	0.31%	8.35%	0.01%	-5.42%	0.30%

### 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

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放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：基金的投资组合比例为：本基金权益类多头头寸的价值减去本基金权益类空头头寸的价值占

基金资产净值的 0-10%之间。本基金投资于同业存单和银行存款的合计占比不超过基金资产的 20%。在开放期的每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。在开放期，每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。本基金的建仓期为自 2020 年 2 月 27 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2023 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 175 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黎海威	本基金的基金经理	2020 年 2 月 27 日	-	20 年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际



					投资管理有限公司) 基金经理、主动股票部副总裁, 香港海通国际资产管理有限公司(海通国际投资管理有限公司) 量化总监。2012 年 8 月加入本公司, 自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理, 现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有 20 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、《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式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，宏观环境总体温和，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 0.83%，业绩比较基准收益率为 1.16%。

## 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。股指期货方面，随着市场情绪改善，股指期货逐步改善，当基差收敛到合理范围内，我们将继续择机提升对冲仓位水平。展望未来，我们预计市场将持续保持热度，并且热点逐步开始轮换，这样的市场环境非常适合量化模型的表现，同时我们要警惕海外风险以及政策收紧带来的市场风险。

本基金主要采用量化对冲的投资策略，一方面坚持采用基金管理人自主研发的量化模型构建股票投资组合，另一方面，灵活应用多种绝对收益策略有效对冲本基金的系统性风险，获取选股的超额收益，追求长期稳定的绝对收益。

## 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、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

本基金为发起式基金，在本报告期内未触及《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

## § 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：景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	27,234,812.13	18,222,578.80
结算备付金		23,138,727.11	26,839,973.56
存出保证金		22,013,054.08	23,859,220.06
交易性金融资产	6.4.7.2	190,118,627.56	168,889,950.31
其中：股票投资		189,814,602.24	168,865,948.31
基金投资		-	-
债券投资		304,025.32	24,002.00
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		326,235.50	1,392,446.09
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		262,831,456.38	239,204,168.82

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>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		150,986.51	1,445,809.72
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		321,257.60	301,033.56
应付托管费		42,834.35	40,137.83
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.85	0.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	209,842.16	316,077.38
负债合计		724,921.47	2,103,058.50
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	254,622,281.22	232,255,358.46
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	7,484,253.69	4,845,751.86
净资产合计		262,106,534.91	237,101,110.32
负债和净资产总计		262,831,456.38	239,204,168.82

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0293 元，基金份额总额 254,622,281.22 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

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>		5,325,018.23	12,194,371.62
1. 利息收入		172,013.59	659,848.58
其中：存款利息收入	6.4.7.13	172,013.59	659,848.58
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）		6,982,903.04	698,841.60
其中：股票投资收益	6.4.7.14	12,169,672.21	-102,222,210.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	89,977.10	2,020,513.12
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-6,791,909.64	97,727,800.08
股利收益	6.4.7.19	1,515,163.37	3,172,738.95
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	-1,950,080.02	10,034,933.39
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	120,181.62	800,748.05
<b>减：二、营业总支出</b>		1,703,855.39	5,942,524.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,415,936.65	4,836,298.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	188,791.57	644,839.72
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		9,708.56	352,096.21
8. 其他费用	6.4.7.23	89,418.61	109,290.94
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		3,621,162.84	6,251,846.65
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		3,621,162.84	6,251,846.65
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		3,621,162.84	6,251,846.65

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

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)	232,255,358.46	-	4,845,751.86	237,101,110.32
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)	232,255,358.46	-	4,845,751.86	237,101,110.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	22,366,922.76	-	2,638,501.83	25,005,424.59
(一)、综合收益总额	-	-	3,621,162.84	3,621,162.84
(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)	22,366,922.76	-	-982,661.01	21,384,261.75
其中：1. 基金申购款	145,724,814.22	-	2,425,968.57	148,150,782.79
2. 基金赎回款	-123,357,891.46	-	-3,408,629.58	-126,766,521.04
(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)	254,622,281.22	-	7,484,253.69	262,106,534.91
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	1,153,475,954.87	-	35,093,219.75	1,188,569,174.62

资产(基金净值)				
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)	1,153,475,954.87	-	35,093,219.75	1,188,569,174.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-777,489,301.44	-	-17,669,092.33	-795,158,393.77
(一)、综合收益总额	-	-	6,251,846.65	6,251,846.65
(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)	-777,489,301.44	-	-23,920,938.98	-801,410,240.42
其中: 1. 基金申购款	13,930,489.13	-	464,342.64	14,394,831.77
2. 基金赎回款	-791,419,790.57	-	-24,385,281.62	-815,805,072.19
(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)	375,986,653.43	-	17,424,127.42	393,410,780.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金(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[2019]2891号《关于准予景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式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《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式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 2,803,173,163.28 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 0106 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 2 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,803,947,219.94 份基金份额,其中认购资金利息折合 774,056.66 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。

本基金为发起式基金,发起资金认购方认购本基金的总额不少于人民币 1,000 万元,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式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的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票及存托凭证)、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、股票期权、国债期货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)。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资融券业务交易。本基金的投资组合比例为:本基金权益类多头头寸的价值减去本基金权益类空头头寸的价值占基金资产净值的 0-10%之间。其中:权益类多头头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。权益类空头头寸价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值。本基金投资于同业存单和银行存款的合计占比不超过基金资产的 20%。开放期内每个交易日日终,本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%,封闭

期内每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。开放期每个交易日日终，在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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等。在封闭期内，本基金不受前述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期 1 年定期存款基准利率（税后）+1%。

本基金以定期开放的方式运作。本基金每三个月开放一次，每次开放期不超过 5 个工作日，每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份在后续每三个日历月中最后一个日历月，每个开放期的首日为当月沪深 300 股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购、赎回与转换业务，且不上市交易。

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	27,234,812.13
等于：本金	27,232,468.02
加：应计利息	2,344.11
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	27,234,812.13

##### 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	190,482,148.09	-	189,814,602.24	-667,545.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	304,000.00	25.32	304,025.32
	银行间市场	-	-	-
	合计	304,000.00	25.32	304,025.32
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	190,786,148.09	25.32	190,118,627.56	-667,545.85

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-181,844,346.71	-	-	-
其中：股指期货投资	-181,844,346.71	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-181,844,346.71	-	-	-

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2307	中证1000股指期货2307合约	-77.00	-101,251,920.00	925,786.71
IM2308	中证1000股指期货2308合约	-62.00	-81,331,600.00	-1,664,960.00
合计				-739,173.29
减：可抵销期货暂收款				-739,173.29

净额					-
----	--	--	--	--	---

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

#### 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	60,582.01
其中：交易所市场	60,582.01
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	149,260.15
合计	209,842.16

## 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	232,255,358.46	232,255,358.46
本期申购	145,724,814.22	145,724,814.22
本期赎回（以“-”号填列）	-123,357,891.46	-123,357,891.46
本期末	254,622,281.22	254,622,281.22

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	8,555,090.37	-3,709,338.51	4,845,751.86
本期利润	5,571,242.86	-1,950,080.02	3,621,162.84
本期基金份额交易产生的变动数	-1,666,016.76	683,355.75	-982,661.01
其中：基金申购款	4,249,988.85	-1,824,020.28	2,425,968.57
基金赎回款	-5,916,005.61	2,507,376.03	-3,408,629.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,460,316.47	-4,976,062.78	7,484,253.69

## 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	30,559.09

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	140,543.97
其他	910.53
合计	172,013.59

#### 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	12,169,672.21
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	12,169,672.21

##### 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	675,852,847.65
减：卖出股票成本总额	662,788,867.92
减：交易费用	894,307.52
买卖股票差价收入	12,169,672.21

##### 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	91.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	89,885.14
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	89,977.10

##### 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	471,975.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	382,000.00
减：应计利息总额	71.31
减：交易费用	18.99
买卖债券差价收入	89,885.14

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	-6,791,909.64

#### 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	1,515,163.37
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	1,515,163.37

## 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	7,316,253.27
股票投资	7,316,253.27
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	-9,266,333.29
权证投资	-
期货投资	-9,266,333.29
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	-1,950,080.02

## 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	120,181.62
合计	120,181.62

## 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	-
银行划款手续费	150.00
存托服务费	8.46
合计	89,418.61

## 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

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	1,415,936.65	4,836,298.10
其中：支付销售机构的客户维护费	320,557.11	656,114.67

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	188,791.57	644,839.72
----------------	------------	------------

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
基金合同生效日（2020 年 2 月 27 日）持有的基金份额	10,001,000.10	10,001,000.10
报告期初持有的基金份额	10,001,000.10	10,001,000.10
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,000.10	10,001,000.10
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.9300%	2.6600%

注：基金管理人景顺长城基金管理有限公司在本年度认购本基金的交易委托景顺长城基金管理有限公司直销中心办理，根据《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的相关规定，适用费率为 1000 元/笔。

## 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
中国工商银行-活期	27,234,812.13	30,559.09	3,985,350.54	63,063.00

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
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	66	3,729.00	3,493.38	-
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	2,155	55,642.10	55,642.10	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	240	6,196.80	6,196.80	-
301246	宏源	2023年3月	6个月	新股流通	50.00	30.71	162	8,100.00	4,975.02	-

	药业	月 10 日		受限						
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	1,623	59,888.70	59,888.70	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	36.90	36.90	181	6,678.90	6,678.90	-
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	4,402	87,995.98	87,995.98	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	19.99	19.99	490	9,795.10	9,795.10	-
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	1,984	9,920.00	17,776.64	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股流通受限	20.67	26.17	593	12,257.31	15,518.81	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	131.11	53.24	45	5,899.95	2,395.80	-
301322	绿通科技	2023 年 5 月 25 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	-	53.24	22	-	1,171.28	转增股
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	53	3,892.85	2,471.92	-
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	-
301373	凌玮	2023 年 1 月	6 个月	新股流通	33.73	31.85	218	7,353.14	6,943.30	-

	科技	月 20 日		受限						
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.27	40.20	205	10,920.35	8,241.00	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流通受限	16.24	16.95	501	8,136.24	8,491.95	-
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	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	181	3,618.19	3,058.90	-
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	1,735	100,040.10	100,040.10	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	57.66	57.66	193	11,128.38	11,128.38	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	281	3,978.96	4,555.01	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	321	6,163.20	8,195.13	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	564	21,364.32	16,632.36	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	592	6,571.20	10,087.68	-
688543	国科	2023 年 6 月	6 个月	新股流通	43.67	53.05	195	8,515.65	10,344.75	-

	军工	月 14 日		受限						
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	297	7,941.78	12,081.96	-
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	802	8,565.36	9,896.68	-
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	215	5,435.20	6,422.05	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127086	恒邦转债	2023 年 6 月 12 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	3,040	304,000.00	304,025.32	-

## 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

截至本报告期末，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

截至本报告期末，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 0.12%（上年度末：0.01%）。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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	27,234,812.13	-	-	-	-	-	27,234,812.13
结算备付金	23,138,727.11	-	-	-	-	-	23,138,727.11
存出保证金	103,031.68	-	-	-	-	21,910,022.40	22,013,054.08
交易性金融资产	-	-	-	-	304,025.32	189,814,602.24	190,118,627.56
应收证券清算款	-	-	-	-	-	326,235.50	326,235.50
资产总计	50,476,570.92	-	-	-	304,025.32	212,050,860.14	262,831,456.38
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	321,257.60	321,257.60
应付托管费	-	-	-	-	-	42,834.35	42,834.35
应付证券清算款	-	-	-	-	-	150,986.51	150,986.51
应交税费	-	-	-	-	-	0.85	0.85
其他负债	-	-	-	-	-	209,842.16	209,842.16
负债总计	-	-	-	-	-	724,921.47	724,921.47

利率敏感度缺口	50,476,570.92	-	-	-	-304,025.32	-	-
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	18,222,578.80	-	-	-	-	-	18,222,578.80
结算备付金	26,839,973.56	-	-	-	-	-	26,839,973.56
存出保证金	110,236.06	-	-	-	-	23,748,984.00	23,859,220.06
交易性金融资产	-	-	-	-	24,002.00	168,865,948.31	168,889,950.31
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,392,446.09	1,392,446.09
资产总计	45,172,788.42	-	-	-	24,002.00	194,007,378.40	239,204,168.82
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	301,033.56	301,033.56
应付托管费	-	-	-	-	-	40,137.83	40,137.83
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,445,809.72	1,445,809.72
应交税费	-	-	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	-	-	316,077.38	316,077.38
负债总计	-	-	-	-	-	2,103,058.50	2,103,058.50
利率敏感度缺口	45,172,788.42	-	-	-	24,002.00	-	-

#### 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 0.12%（上年度末：0.01%），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	189,814,602.24	72.42	168,865,948.31	71.22
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	189,814,602.24	72.42	168,865,948.31	71.22

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

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	945,177.86	86,664.23
	沪深 300 指数下降 5%	-945,177.86	-86,664.23

## 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	189,207,564.12	167,597,909.90
第二层次	735,673.02	424,427.60
第三层次	175,390.42	867,612.81
合计	190,118,627.56	168,889,950.31

## 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	189,814,602.24	72.22
	其中：股票	189,814,602.24	72.22

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	304,025.32	0.12
	其中：债券	304,025.32	0.12
	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	50,373,539.24	19.17
8	其他各项资产	22,339,289.58	8.50
9	合计	262,831,456.38	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	561,093.00	0.21
B	采矿业	2,586,938.00	0.99
C	制造业	129,967,122.42	49.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,694,185.00	1.79
E	建筑业	3,930,748.00	1.50
F	批发和零售业	4,454,380.27	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	1,299,016.00	0.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,780,584.94	9.07
J	金融业	4,426,319.70	1.69
K	房地产业	4,360,972.00	1.66
L	租赁和商务服务业	2,337,772.90	0.89
M	科学研究和技术服务业	2,696,721.01	1.03
N	水利、环境和公共设施管理业	695,129.00	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	408,114.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	3,218,028.00	1.23
S	综合	397,478.00	0.15
	合计	189,814,602.24	72.42

### 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	603345	安井食品	12,600	1,849,680.00	0.71
2	300777	中简科技	37,900	1,791,154.00	0.68
3	600502	安徽建工	338,500	1,787,280.00	0.68
4	002402	和而泰	103,000	1,748,940.00	0.67
5	002139	拓邦股份	132,700	1,731,735.00	0.66
6	002017	东信和平	128,150	1,680,046.50	0.64
7	603027	千禾味业	77,300	1,632,576.00	0.62
8	300775	三角防务	48,200	1,628,196.00	0.62
9	002212	天融信	166,800	1,617,960.00	0.62
10	000528	柳工	202,440	1,599,276.00	0.61
11	300674	宇信科技	89,200	1,577,056.00	0.60
12	300109	新开源	62,900	1,564,323.00	0.60
13	600612	老凤祥	22,200	1,551,336.00	0.59
14	002396	星网锐捷	68,600	1,549,674.00	0.59
15	601137	博威合金	99,400	1,546,664.00	0.59
16	002335	科华数据	42,500	1,527,875.00	0.58
17	002698	博实股份	87,200	1,525,128.00	0.58
18	002815	崇达技术	122,500	1,525,125.00	0.58
19	002215	诺普信	202,700	1,522,277.00	0.58
20	300232	洲明科技	166,500	1,521,810.00	0.58
21	000048	京基智农	77,400	1,510,848.00	0.58
22	002283	天润工业	234,300	1,504,206.00	0.57
23	600789	鲁抗医药	232,600	1,493,292.00	0.57
24	002126	银轮股份	83,900	1,485,030.00	0.57
25	002610	爱康科技	578,500	1,480,960.00	0.57
26	000951	中国重汽	87,800	1,479,430.00	0.56
27	002421	达实智能	414,600	1,459,392.00	0.56
28	300869	康泰医学	63,500	1,457,960.00	0.56
29	600064	南京高科	216,900	1,433,709.00	0.55
30	601619	嘉泽新能	312,300	1,420,965.00	0.54
31	002649	博彦科技	97,500	1,377,675.00	0.53
32	600073	上海梅林	185,100	1,351,230.00	0.52
33	600864	哈投股份	263,900	1,348,529.00	0.51
34	603881	数据港	56,120	1,267,750.80	0.48
35	601908	京运通	208,100	1,259,005.00	0.48
36	300206	理邦仪器	83,200	1,254,656.00	0.48
37	002489	浙江永强	306,500	1,241,325.00	0.47
38	301039	中集车辆	92,400	1,222,452.00	0.47
39	300773	拉卡拉	69,700	1,215,568.00	0.46
40	600420	国药现代	107,605	1,214,860.45	0.46



41	600211	西藏药业	20,300	1,205,820.00	0.46
42	600635	大众公用	362,500	1,203,500.00	0.46
43	601222	林洋能源	146,200	1,197,378.00	0.46
44	688556	高测股份	21,780	1,157,389.20	0.44
45	002768	国恩股份	47,000	1,136,930.00	0.43
46	002517	恺英网络	71,600	1,126,984.00	0.43
47	600210	紫江企业	210,900	1,121,988.00	0.43
48	002158	汉钟精机	43,900	1,095,744.00	0.42
49	603368	柳药集团	43,400	1,072,414.00	0.41
50	002020	京新药业	83,400	1,069,188.00	0.41
51	603466	风语筑	75,900	1,055,010.00	0.40
52	600480	凌云股份	131,980	1,037,362.80	0.40
53	601126	四方股份	66,300	1,007,097.00	0.38
54	600750	江中药业	45,900	1,006,587.00	0.38
55	300855	图南股份	28,380	1,002,381.60	0.38
56	002737	葵花药业	40,058	975,011.72	0.37
57	300856	科思股份	11,900	937,363.00	0.36
58	600285	羚锐制药	57,200	918,632.00	0.35
59	000829	天音控股	101,200	914,848.00	0.35
60	300638	广和通	40,141	910,397.88	0.35
61	300123	亚光科技	123,700	900,536.00	0.34
62	002063	远光软件	102,122	886,418.96	0.34
63	688508	芯朋微	14,865	862,021.35	0.33
64	601929	吉视传媒	465,200	855,968.00	0.33
65	002895	川恒股份	42,600	839,220.00	0.32
66	000913	钱江摩托	46,000	838,580.00	0.32
67	300352	北信源	164,500	829,080.00	0.32
68	600057	厦门象屿	95,050	826,935.00	0.32
69	000921	海信家电	30,400	819,280.00	0.31
70	300130	新国都	28,800	815,904.00	0.31
71	300416	苏试试验	37,600	810,656.00	0.31
72	600662	外服控股	140,900	805,948.00	0.31
73	600531	豫光金铅	126,900	799,470.00	0.31
74	002967	广电计量	39,700	797,573.00	0.30
75	002987	京北方	36,300	795,696.00	0.30
76	600821	金开新能	115,200	793,728.00	0.30
77	600320	振华重工	212,600	792,998.00	0.30
78	002617	露笑科技	99,600	784,848.00	0.30
79	002038	双鹭药业	77,300	779,957.00	0.30
80	002747	埃斯顿	27,400	767,200.00	0.29
81	002237	恒邦股份	70,000	762,300.00	0.29
82	000517	荣安地产	248,000	756,400.00	0.29
83	002011	盾安环境	53,900	745,437.00	0.28

84	600267	海正药业	65,400	744,252.00	0.28
85	300672	国科微	8,900	741,815.00	0.28
86	600458	时代新材	61,700	739,783.00	0.28
87	300567	精测电子	7,600	723,140.00	0.28
88	300263	隆华科技	86,300	718,016.00	0.27
89	000560	我爱我家	266,300	705,695.00	0.27
90	601519	大智慧	97,900	700,964.00	0.27
91	000650	仁和药业	112,600	691,364.00	0.26
92	002746	仙坛股份	87,700	691,076.00	0.26
93	605111	新洁能	15,788	687,093.76	0.26
94	002446	盛路通信	72,100	681,345.00	0.26
95	000915	华特达因	19,300	681,097.00	0.26
96	600633	浙数文化	41,800	677,578.00	0.26
97	300002	神州泰岳	47,400	663,600.00	0.25
98	688711	宏微科技	11,263	657,083.42	0.25
99	300065	海兰信	51,600	639,324.00	0.24
100	002597	金禾实业	26,500	625,400.00	0.24
101	603103	横店影视	36,600	616,344.00	0.24
102	300119	瑞普生物	34,200	608,760.00	0.23
103	603690	至纯科技	17,120	596,460.80	0.23
104	603323	苏农银行	137,800	580,138.00	0.22
105	300973	立高食品	8,400	574,728.00	0.22
106	603301	振德医疗	19,200	568,704.00	0.22
107	601311	骆驼股份	61,100	567,008.00	0.22
108	000860	顺鑫农业	16,800	565,992.00	0.22
109	688268	华特气体	6,847	552,758.31	0.21
110	002060	粤水电	83,900	552,062.00	0.21
111	600577	精达股份	129,300	545,646.00	0.21
112	600312	平高电气	43,900	543,921.00	0.21
113	002706	良信股份	48,200	542,250.00	0.21
114	603919	金徽酒	23,000	540,040.00	0.21
115	002611	东方精工	92,300	529,802.00	0.20
116	000928	中钢国际	54,700	527,855.00	0.20
117	000028	国药一致	12,000	523,320.00	0.20
118	002400	省广集团	108,500	521,885.00	0.20
119	002436	兴森科技	33,300	516,150.00	0.20
119	603566	普莱柯	22,200	516,150.00	0.20
120	002416	爱施德	68,000	501,840.00	0.19
121	000422	湖北宣化	43,600	500,528.00	0.19
122	300133	华策影视	70,300	498,427.00	0.19
123	300693	盛弘股份	13,500	498,420.00	0.19
124	600201	生物股份	52,248	496,878.48	0.19
125	688019	安集科技	2,990	492,841.70	0.19

126	002978	安宁股份	15,300	491,283.00	0.19
127	601567	三星医疗	37,900	478,677.00	0.18
128	600888	新疆众和	59,800	473,616.00	0.18
129	000848	承德露露	52,800	467,280.00	0.18
130	601528	瑞丰银行	96,000	465,600.00	0.18
131	688518	联赢激光	16,628	463,256.08	0.18
132	002324	普利特	32,300	460,921.00	0.18
133	002467	二六三	92,700	460,719.00	0.18
134	603328	依顿电子	55,600	460,368.00	0.18
135	688123	聚辰股份	8,550	459,306.00	0.18
136	300666	江丰电子	6,700	455,332.00	0.17
137	301087	可孚医疗	9,200	453,560.00	0.17
138	688018	乐鑫科技	3,429	445,152.78	0.17
139	603005	晶方科技	21,800	440,360.00	0.17
140	002918	蒙娜丽莎	28,400	438,496.00	0.17
141	301095	广立微	5,300	438,045.00	0.17
142	605009	豪悦护理	9,000	432,000.00	0.16
143	600639	浦东金桥	34,600	429,386.00	0.16
144	600129	太极集团	7,200	428,328.00	0.16
145	300294	博雅生物	11,800	428,104.00	0.16
146	603197	保隆科技	7,700	417,725.00	0.16
147	002085	万丰奥威	59,300	410,949.00	0.16
148	002044	美年健康	57,400	408,114.00	0.16
149	000758	中色股份	86,000	405,920.00	0.15
150	688037	芯源微	2,374	405,835.30	0.15
151	600456	宝钛股份	11,900	402,696.00	0.15
152	600770	综艺股份	70,600	397,478.00	0.15
153	003006	百亚股份	22,500	388,800.00	0.15
154	002234	民和股份	20,900	380,589.00	0.15
155	601028	玉龙股份	35,400	380,550.00	0.15
156	000818	航锦科技	11,400	380,418.00	0.15
157	300031	宝通科技	15,200	375,744.00	0.14
158	688131	皓元医药	6,400	364,672.00	0.14
159	600197	伊力特	13,300	361,361.00	0.14
160	000567	海德股份	28,035	359,408.70	0.14
161	002636	金安国纪	38,900	359,047.00	0.14
162	600559	老白干酒	14,600	357,846.00	0.14
163	601677	明泰铝业	25,600	355,328.00	0.14
164	600363	联创光电	9,500	352,450.00	0.13
165	300593	新雷能	14,700	336,777.00	0.13
166	688559	海目星	7,123	334,852.23	0.13
167	002544	普天科技	14,600	334,340.00	0.13
168	600273	嘉化能源	35,300	332,526.00	0.13

169	600478	科力远	46,500	332,010.00	0.13
170	688066	航天宏图	5,400	328,860.00	0.13
171	603997	继峰股份	22,900	327,470.00	0.12
172	300735	光弘科技	30,600	327,420.00	0.12
173	300035	中科电气	26,800	322,136.00	0.12
174	002051	中工国际	27,000	322,110.00	0.12
175	601019	山东出版	35,100	321,867.00	0.12
176	688680	海优新材	2,600	316,732.00	0.12
177	601001	晋控煤业	33,600	314,496.00	0.12
178	600483	福能股份	27,100	313,005.00	0.12
179	601965	中国汽研	15,100	311,815.00	0.12
180	600323	瀚蓝环境	16,400	310,452.00	0.12
181	300131	英唐智控	59,100	310,275.00	0.12
182	688425	铁建重工	64,200	308,802.00	0.12
183	600446	金证股份	21,200	308,248.00	0.12
184	603212	赛伍技术	14,800	307,988.00	0.12
185	002130	沃尔核材	37,900	307,748.00	0.12
186	600552	凯盛科技	25,800	305,472.00	0.12
187	688707	振华新材	9,900	304,821.00	0.12
188	603505	金石资源	13,000	303,550.00	0.12
189	002605	姚记科技	6,500	301,795.00	0.12
190	601369	陕鼓动力	33,100	301,541.00	0.12
191	300379	东方通	14,600	300,322.00	0.11
192	000555	神州信息	24,400	300,120.00	0.11
193	002851	麦格米特	8,200	299,054.00	0.11
194	600977	中国电影	21,200	297,860.00	0.11
195	600850	电科数字	12,600	297,234.00	0.11
196	603033	三维股份	14,600	297,110.00	0.11
197	603018	华设集团	33,900	296,625.00	0.11
198	300696	爱乐达	12,000	295,200.00	0.11
199	300613	富瀚微	5,200	295,048.00	0.11
200	600059	古越龙山	28,400	294,792.00	0.11
201	001696	宗申动力	41,600	294,528.00	0.11
202	300443	金雷股份	8,300	294,235.00	0.11
203	600578	京能电力	75,100	293,641.00	0.11
204	002106	莱宝高科	34,500	293,250.00	0.11
205	002194	武汉凡谷	26,800	292,924.00	0.11
206	600037	歌华有线	35,100	291,681.00	0.11
207	000685	中山公用	38,500	291,445.00	0.11
208	000403	派林生物	14,600	291,416.00	0.11
209	688001	华兴源创	8,200	290,444.00	0.11
210	688007	光峰科技	13,900	289,815.00	0.11
211	000603	盛达资源	23,900	288,951.00	0.11

212	300382	斯莱克	21,900	288,861.00	0.11
213	300633	开立医疗	5,300	288,850.00	0.11
214	003040	楚天龙	15,900	288,426.00	0.11
215	000801	四川九洲	39,500	288,350.00	0.11
216	600797	浙大网新	40,100	286,314.00	0.11
217	600587	新华医疗	8,100	286,173.00	0.11
218	603567	珍宝岛	19,100	285,736.00	0.11
219	300226	上海钢联	8,800	285,120.00	0.11
220	300134	大富科技	27,800	284,950.00	0.11
221	603306	华懋科技	9,800	284,396.00	0.11
222	688127	蓝特光学	16,100	283,843.00	0.11
223	000688	国城矿业	18,700	283,679.00	0.11
224	600966	博汇纸业	47,700	282,384.00	0.11
225	300079	数码视讯	46,200	281,820.00	0.11
226	600990	四创电子	8,900	281,596.00	0.11
227	000881	中广核技	34,200	281,466.00	0.11
228	688586	江航装备	20,200	280,982.00	0.11
229	300102	乾照光电	42,600	280,308.00	0.11
230	601069	西部黄金	21,600	277,344.00	0.11
231	300358	楚天科技	18,500	276,205.00	0.11
232	600184	光电股份	21,000	275,730.00	0.11
233	002651	利君股份	35,400	275,058.00	0.10
234	603612	索通发展	15,800	273,814.00	0.10
235	300377	赢时胜	33,800	273,780.00	0.10
236	002267	陕天然气	34,500	273,240.00	0.10
237	688499	利元亨	4,300	273,136.00	0.10
238	600641	万业企业	14,300	272,987.00	0.10
239	300183	东软载波	16,500	272,415.00	0.10
240	002859	洁美科技	9,800	271,460.00	0.10
241	000761	本钢板材	67,800	271,200.00	0.10
242	300981	中红医疗	17,900	271,185.00	0.10
243	300762	上海瀚讯	23,000	270,710.00	0.10
244	002782	可立克	17,700	270,633.00	0.10
245	300663	科蓝软件	19,900	270,441.00	0.10
246	600984	建设机械	59,500	268,940.00	0.10
247	600206	有研新材	20,400	268,056.00	0.10
248	002549	凯美特气	23,300	267,950.00	0.10
249	603609	禾丰股份	29,300	266,630.00	0.10
250	688206	概伦电子	9,500	266,380.00	0.10
251	600007	中国国贸	14,200	262,984.00	0.10
252	000737	北方铜业	48,400	260,876.00	0.10
253	603093	南华期货	23,900	260,271.00	0.10
254	000061	农产品	43,400	259,966.00	0.10

255	002583	海能达	44,300	257,383.00	0.10
256	002214	大立科技	18,800	256,620.00	0.10
257	688356	键凯科技	2,400	255,720.00	0.10
258	603208	江山欧派	7,020	255,668.40	0.10
259	000058	深赛格	41,100	253,998.00	0.10
260	603098	森特股份	12,300	252,150.00	0.10
261	000950	重药控股	37,300	251,029.00	0.10
262	688526	科前生物	10,400	247,416.00	0.09
263	688578	艾力斯	9,100	245,245.00	0.09
264	603300	华铁应急	44,600	243,070.00	0.09
265	688399	硕世生物	4,400	242,880.00	0.09
266	002287	奇正藏药	10,100	241,390.00	0.09
267	600459	贵研铂业	15,500	237,150.00	0.09
268	600328	中盐化工	26,340	237,060.00	0.09
269	002100	天康生物	28,100	231,825.00	0.09
270	300203	聚光科技	11,400	231,078.00	0.09
271	600550	保变电气	45,800	230,832.00	0.09
272	000498	山东路桥	35,900	230,478.00	0.09
273	688575	亚辉龙	12,400	228,780.00	0.09
274	688270	臻镭科技	3,500	227,255.00	0.09
275	002453	华软科技	21,200	226,628.00	0.09
276	300827	上能电气	6,277	226,285.85	0.09
277	300348	长亮科技	21,500	224,460.00	0.09
278	600583	海油工程	37,900	221,715.00	0.08
279	300770	新媒股份	4,800	220,128.00	0.08
280	601975	招商南油	76,900	219,934.00	0.08
281	688298	东方生物	5,789	218,361.08	0.08
282	600776	东方通信	15,300	218,025.00	0.08
283	601801	皖新传媒	23,200	217,848.00	0.08
284	600908	无锡银行	40,600	217,616.00	0.08
285	601208	东材科技	17,100	217,170.00	0.08
286	605589	圣泉集团	9,800	213,052.00	0.08
287	688110	东芯股份	5,900	212,990.00	0.08
288	300054	鼎龙股份	8,600	212,678.00	0.08
289	600185	格力地产	30,900	211,974.00	0.08
290	002123	梦网科技	15,900	211,311.00	0.08
291	300860	锋尚文化	3,800	210,672.00	0.08
292	300170	汉得信息	17,900	206,566.00	0.08
293	603348	文灿股份	4,700	205,907.00	0.08
294	601963	重庆银行	25,900	204,869.00	0.08
295	600248	陕建股份	42,900	204,633.00	0.08
296	603032	德新科技	5,900	203,786.00	0.08
297	605369	拱东医疗	3,600	201,744.00	0.08

298	600773	西藏城投	15,900	200,340.00	0.08
299	605388	均瑶健康	15,700	199,547.00	0.08
300	300101	振芯科技	10,200	197,778.00	0.08
301	600993	马应龙	7,100	197,451.00	0.08
302	300687	赛意信息	7,100	197,238.00	0.08
303	605376	博迁新材	6,200	194,556.00	0.07
304	300662	科锐国际	5,500	194,535.00	0.07
305	300068	南都电源	9,500	183,920.00	0.07
306	002635	安洁科技	13,300	183,540.00	0.07
307	300260	新莱应材	4,600	181,792.00	0.07
308	000735	罗牛山	27,600	180,504.00	0.07
309	688139	海尔生物	3,500	180,145.00	0.07
310	002413	雷科防务	34,300	179,389.00	0.07
311	002961	瑞达期货	12,200	175,802.00	0.07
312	300428	立中集团	7,600	175,256.00	0.07
313	300627	华测导航	5,300	172,091.00	0.07
314	002428	云南锗业	13,900	169,024.00	0.06
315	002697	红旗连锁	28,800	168,192.00	0.06
316	603013	亚普股份	10,700	167,776.00	0.06
317	600557	康缘药业	6,000	164,760.00	0.06
318	002006	精工科技	7,600	163,932.00	0.06
319	000557	西部创业	31,000	163,370.00	0.06
320	603636	南威软件	11,100	162,837.00	0.06
321	688233	神工股份	5,100	161,058.00	0.06
322	300820	英杰电气	1,950	160,641.00	0.06
323	688733	壹石通	5,100	157,896.00	0.06
324	300811	铂科新材	2,500	148,600.00	0.06
325	300755	华致酒行	6,600	148,302.00	0.06
326	600172	黄河旋风	34,600	148,088.00	0.06
327	300738	奥飞数据	14,500	147,900.00	0.06
328	600986	浙文互联	22,400	143,360.00	0.05
329	600729	重庆百货	4,400	138,336.00	0.05
330	002233	塔牌集团	17,700	136,644.00	0.05
331	600929	雪天盐业	17,200	136,568.00	0.05
332	603718	海利生物	14,300	134,849.00	0.05
333	300151	昌红科技	7,200	130,320.00	0.05
334	002929	润建股份	2,800	121,548.00	0.05
335	688161	威高骨科	2,800	121,268.00	0.05
336	688568	中科星图	1,500	120,870.00	0.05
337	300747	锐科激光	3,900	118,872.00	0.05
338	301089	拓新药业	1,900	117,686.00	0.04
339	601200	上海环境	12,300	116,727.00	0.04
340	600877	电科芯片	7,800	116,532.00	0.04

341	000811	冰轮环境	7,300	115,048.00	0.04
342	300319	麦捷科技	13,200	112,992.00	0.04
343	301486	致尚科技	1,928	111,168.48	0.04
344	688202	美迪西	1,300	110,825.00	0.04
345	002182	云海金属	5,000	109,950.00	0.04
346	002612	朗姿股份	4,600	109,388.00	0.04
347	000969	安泰科技	11,500	108,905.00	0.04
348	002135	东南网架	16,500	106,590.00	0.04
349	002645	华宏科技	8,400	102,984.00	0.04
350	688598	金博股份	600	102,900.00	0.04
351	603229	奥翔药业	4,900	102,802.00	0.04
352	300323	华灿光电	14,700	100,695.00	0.04
353	301292	海科新源	4,892	97,791.08	0.04
354	000901	航天科技	9,000	96,300.00	0.04
355	600869	远东股份	17,100	94,392.00	0.04
356	603236	移远通信	1,600	92,336.00	0.04
357	300900	广联航空	3,200	92,192.00	0.04
358	300457	赢合科技	5,000	88,300.00	0.03
359	000875	吉电股份	15,800	85,162.00	0.03
360	300502	新易盛	1,200	81,564.00	0.03
361	002558	巨人网络	4,400	78,892.00	0.03
362	300725	药石科技	1,600	77,488.00	0.03
363	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.03
364	603801	志邦家居	2,300	75,946.00	0.03
365	301207	华兰疫苗	2,200	73,172.00	0.03
366	002695	煌上煌	6,800	72,692.00	0.03
367	603533	掌阅科技	2,500	69,300.00	0.03
368	300653	正海生物	2,000	68,780.00	0.03
369	688261	东微半导	480	67,137.60	0.03
370	301261	恒工精密	1,804	66,567.60	0.03
371	300458	全志科技	2,400	65,400.00	0.02
372	300451	创业慧康	7,800	65,364.00	0.02
373	000885	城发环境	4,900	65,219.00	0.02
374	300598	诚迈科技	1,400	64,638.00	0.02
375	600761	安徽合力	3,200	63,776.00	0.02
376	300085	银之杰	5,300	62,328.00	0.02
377	301202	朗威股份	2,395	61,838.90	0.02
378	300737	科顺股份	6,700	61,372.00	0.02
379	688608	恒玄科技	500	60,515.00	0.02
380	002891	中宠股份	2,500	60,350.00	0.02
381	688091	上海谊众	800	58,904.00	0.02
382	601860	紫金银行	23,400	58,734.00	0.02
383	002317	众生药业	3,400	57,766.00	0.02



384	002314	南山控股	17,400	57,420.00	0.02
385	002941	新疆交建	3,500	54,180.00	0.02
386	603171	税友股份	1,300	51,974.00	0.02
387	002675	东诚药业	3,300	48,543.00	0.02
388	603766	隆鑫通用	8,600	45,408.00	0.02
389	603713	密尔克卫	500	44,545.00	0.02
390	688235	百济神州	400	43,644.00	0.02
391	689009	九号公司	1,179	43,446.15	0.02
392	300470	中密控股	900	41,598.00	0.02
393	601882	海天精工	1,200	39,960.00	0.02
394	003031	中瓷电子	300	39,936.00	0.02
395	300803	指南针	800	38,872.00	0.01
396	605168	三人行	435	37,383.90	0.01
397	688266	泽璟制药	800	37,240.00	0.01
398	600710	苏美达	4,297	36,782.32	0.01
399	688173	希荻微	1,500	34,320.00	0.01
400	600391	航发科技	1,300	31,343.00	0.01
401	688366	昊海生科	300	25,266.00	0.01
402	688082	盛美上海	200	22,080.00	0.01
403	688050	爱博医疗	100	20,533.00	0.01
404	688318	财富趋势	200	19,994.00	0.01
405	603396	金辰股份	300	19,680.00	0.01
406	300332	天壕环境	1,700	19,499.00	0.01
407	603363	傲农生物	2,100	19,257.00	0.01
408	000006	深振业 A	4,300	18,791.00	0.01
409	603105	芯能科技	1,100	18,579.00	0.01
410	301301	川宁生物	1,984	17,776.64	0.01
411	002832	比音勒芬	500	17,705.00	0.01
412	688200	华峰测控	114	17,442.00	0.01
413	688596	正帆科技	400	17,320.00	0.01
414	688033	天宜上佳	900	17,208.00	0.01
415	600151	航天机电	1,900	16,929.00	0.01
416	688630	芯碁微装	200	16,804.00	0.01
417	688443	智翔金泰	564	16,632.36	0.01
418	002302	西部建设	2,300	16,422.00	0.01
419	688148	芳源股份	1,300	15,860.00	0.01
420	301317	鑫磊股份	593	15,518.81	0.01
421	600783	鲁信创投	1,200	15,516.00	0.01
422	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.01
423	300604	长川科技	300	14,247.00	0.01
424	603678	火炬电子	400	13,784.00	0.01
425	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.01
426	301358	湖南裕能	298	12,781.22	0.00

427	688582	芯动联科	297	12,081.96	0.00
428	300398	飞凯材料	700	12,033.00	0.00
429	600223	福瑞达	1,100	11,286.00	0.00
430	688543	国科军工	195	10,344.75	0.00
431	605020	永和股份	400	10,324.00	0.00
432	688472	阿特斯	592	10,087.68	0.00
433	688620	安凯微	802	9,896.68	0.00
434	301408	华人健康	501	8,491.95	0.00
435	603733	仙鹤股份	400	8,340.00	0.00
436	301397	溯联股份	205	8,241.00	0.00
437	688429	时创能源	321	8,195.13	0.00
438	301373	凌玮科技	218	6,943.30	0.00
439	688631	莱斯信息	215	6,422.05	0.00
440	301246	宏源药业	162	4,975.02	0.00
441	688334	西高院	281	4,555.01	0.00
442	301322	绿通科技	67	3,567.08	0.00
443	301157	华塑科技	66	3,493.38	0.00
444	301439	泓淋电力	181	3,058.90	0.00
445	300327	中颖电子	100	2,796.00	0.00
446	301345	涛涛车业	53	2,471.92	0.00
447	300007	汉威科技	100	2,115.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600797	浙大网新	5,095,859.00	2.15
2	301039	中集车辆	4,874,408.00	2.06
3	002597	金禾实业	4,815,090.00	2.03
4	601137	博威合金	4,408,712.00	1.86
5	605388	均瑶健康	4,393,154.00	1.85
6	600850	电科数字	3,950,699.00	1.67
7	002126	银轮股份	3,902,671.00	1.65
8	600073	上海梅林	3,881,015.00	1.64
9	002421	达实智能	3,823,457.00	1.61
10	600502	安徽建工	3,753,270.00	1.58
11	600420	国药现代	3,729,432.00	1.57
12	002463	沪电股份	3,617,300.00	1.53
13	002518	科士达	3,616,401.00	1.53
14	002746	仙坛股份	3,572,744.00	1.51
15	603027	千禾味业	3,456,638.00	1.46
16	600572	康恩贝	3,442,115.00	1.45
17	603118	共进股份	3,430,228.00	1.45

18	600789	鲁抗医药	3,429,160.00	1.45
19	000758	中色股份	3,406,082.00	1.44
20	300856	科思股份	3,397,025.00	1.43

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	002597	金禾实业	6,671,408.48	2.81
2	002463	沪电股份	5,947,227.00	2.51
3	300352	北信源	5,894,275.00	2.49
4	000758	中色股份	5,849,507.00	2.47
5	603118	共进股份	5,713,659.00	2.41
6	600797	浙大网新	4,951,268.00	2.09
7	600481	双良节能	4,693,711.00	1.98
8	301039	中集车辆	4,665,504.24	1.97
9	000917	电广传媒	4,569,604.72	1.93
10	600210	紫江企业	4,550,718.00	1.92
11	600073	上海梅林	4,472,407.00	1.89
12	002697	红旗连锁	4,435,378.00	1.87
13	002276	万马股份	4,323,232.00	1.82
14	605388	均瑶健康	4,178,239.00	1.76
15	600971	恒源煤电	4,136,745.00	1.74
16	000517	荣安地产	4,040,954.00	1.70
17	300900	广联航空	3,988,968.00	1.68
18	601375	中原证券	3,973,024.00	1.68
19	600284	浦东建设	3,931,370.60	1.66
20	600572	康恩贝	3,896,190.00	1.64

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	676,421,268.58
卖出股票收入（成交）总额	675,852,847.65

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）	304,025.32	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	304,025.32	0.12

## 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	127086	恒邦转债	3,040	304,025.32	0.12

## 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

本基金现阶段主要通过股指期货有效对冲持有股票的系统性风险。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理和风险控制的原则，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金通过对现货和期货市场相关性研究，计算需要的股指期货合约数量，并根据不同期货合约定价关系、保证金要求、流动性情况等因素，对股指期货合约数量及配比进行动态调整，寻求与现货资产的匹配，力争构建市场中性投资组合并获得稳定的正向超额收益。

随着监管的放开及融资、融券等其他对冲工具的优势增强，本基金会优选空头工具，采用最优的多头系统性风险剥离方式。

## 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

本基金可投资国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

### 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 市场中性策略执行情况

截至本报告期末,本基金持有股票资产 189,814,602.24 元,占基金资产净值的比例为 72.42%;运用股指期货进行对冲的空头合约市值-182,583,520.00 元,占基金资产净值的比例为-69.66%,空头合约市值占股票资产的比例为-96.19%。本报告期内,本基金执行市场中性策略的投资收益为 5,377,762.57 元,公允价值变动损益为-1,950,080.02 元。

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 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。

#### 7.13.2 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。

#### 7.13.3 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	22,013,054.08
2	应收清算款	326,235.50
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,339,289.58

#### 7.13.4 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。

#### 7.13.5 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。

#### 7.13.6 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 (%)
10,677	23,847.74	164,636,294.76	64.66	89,985,986.46	35.34

### 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	1,704.28	0.000669

### 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

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

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比 例 (%)	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例 (%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资 金	10,001,000.10	3.93	10,000,000.00	0.36	3 年
基金管理人高级管 理人员	-	-	-	-	不适用
基金经理等人员	-	-	-	-	不适用
基金管理人股东	-	-	-	-	不适用
其他	-	-	-	-	不适用
合计	10,001,000.10	3.93	10,000,000.00	0.36	-

注：发起份额总数为不包含利息的认购份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020 年 2 月 27 日) 基金份额总额	2,803,947,219.94
本报告期期初基金份额总额	232,255,358.46

本报告期基金总申购份额	145,724,814.22
减：本报告期基金总赎回份额	123,357,891.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	254,622,281.22

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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			比例 (%)		(%)	
东方证券股份有限公司	3	1,349,572,349.03	100.00	109,722.99	100.00	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
申港证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
中航证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-



证券股份 有限公司							
中信证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	-
中邮证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	本期 报告 新增 1 个
安信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	-
高盛（中 国）证券有 限责任公 司	1	-	-	-	-	-	-
第一创业 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	-
国盛证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	-
恒泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
民生证券 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	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河 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(%)
东方证券股份有限公司	471,975.44	100.00	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证	-	-	-	-	-	-

券股份 有限公司						
开源证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
申港证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中信证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中邮证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证 券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
高盛(中 国)证券	1	-	-	-	-	-

有限责 任公司						
第一创 业证券 股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
方正证 券股份 有限公 司	2	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	1	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	1	-	-	-	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
海通证 券股份 有限公 司	1	-	-	-	-	-
恒泰证 券股份 有限公 司	1	-	-	-	-	-
华创证 券有限 责任公 司	1	-	-	-	-	-
华西证 券股份 有限公 司	1	-	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公 司	1	-	-	-	-	-
平安证 券股份 有限公 司	1	-	-	-	-	-

司						
瑞信证券(中国)有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

### 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	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 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
2	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
3	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2023 年 2 月 10 日至 2023 年 2 月 16 日第十二个开放期开放申购、赎	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 7 日

	回及转换业务和规模控制安排的公告		
4	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2023 年 2 月 10 日至 2023 年 2 月 16 日第十二个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 8 日
5	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2023 年 2 月 10 日至 2023 年 2 月 16 日第十二个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 9 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 10 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业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 2 月 20 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 2 月 24 日
9	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
10	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
11	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
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 8 日
13	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
14	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 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
15	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
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 4 月 22 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 6 日
18	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2023 年 5 月 12 日至 2023 年 5 月 18 日第十三个开放期开放申购、赎	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 10 日

	回及转换业务和规模控制安排的公告		
19	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2023 年 5 月 12 日至 2023 年 5 月 18 日第十三个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 11 日
20	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2023 年 5 月 12 日至 2023 年 5 月 18 日第十三个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 12 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 13 日
22	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金新增江海证券为销售机构并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 5 月 15 日
23	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金新增中国银河证券为销售机构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 5 月 15 日
24	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
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 10 日
26	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
27	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
28	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机	1	20230214-20230515	28,486,665.59	0.00	20,000,000.00	8,486,665.59	3.33



构	2	20230213-20230213	43,532,619.55	0.00	43,532,619.55	0.00	0.00
产品特有风险							
<p>本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：</p> <p>1、大额申购风险</p> <p>在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：</p> <p>（1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>（2）如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>（3）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>（4）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p> <p>（5）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；</p> <p>（6）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p> <p>本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。</p>							

## 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对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》；

- 4、《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式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