

景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券  
投资基金（QDII）  
2024 年中期报告

2024 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.9 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	12
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 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	36
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	36

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....	37
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	42
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	44
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	44
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	45
7.11 投资组合报告附注 .....	45
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	46
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8 其他重大事件 .....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</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 .....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)
基金简称	景顺长城恒生消费 ETF (QDII)
场内简称	恒生消费 (扩位简称: 恒生消费 ETF)
基金主代码	513970
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 4 月 12 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	267,041,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 4 月 21 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。
投资策略	<p>本基金采用完全复制的被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或者因法律法规限制时，或其他原因导致无法有效负责和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，对投资组合管理进行适当性变更和调整，力争降低跟踪误差。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。如因标的指数编制规则调整、港股通交易机制等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p>
业绩比较基准	恒生消费指数收益率 (使用估值汇率折算)
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p> <p>此外，本基金主要投资于香港等境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及香港等境外市场的风险。</p>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	景顺长城基金管理有限公司		兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳	龚小武
	联系电话	0755-82370388	021-52629999-212056
	电子邮箱	investor@igwfm.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话	4008888606	95561	
传真	0755-22381339	021-62159217	
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	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦	
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	上海市浦东新区银城路167号4楼	
邮政编码	518048	200120	
法定代表人	李进	吕家进	

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	140 Broadway New York
办公地址		-	140 Broadway New York
邮政编码		-	NY 10005

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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

## 2.6 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-15,989,770.44
本期利润	-10,611,610.42
加权平均基金份额本期利润	-0.0366
本期加权平均净值利润率	-4.65%
本期基金份额净值增长率	-5.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-67,479,030.16

期末可供分配基金份额利润	-0.2527
期末基金资产净值	199,561,969.84
期末基金份额净值	0.7473
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-25.27%

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小数。

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

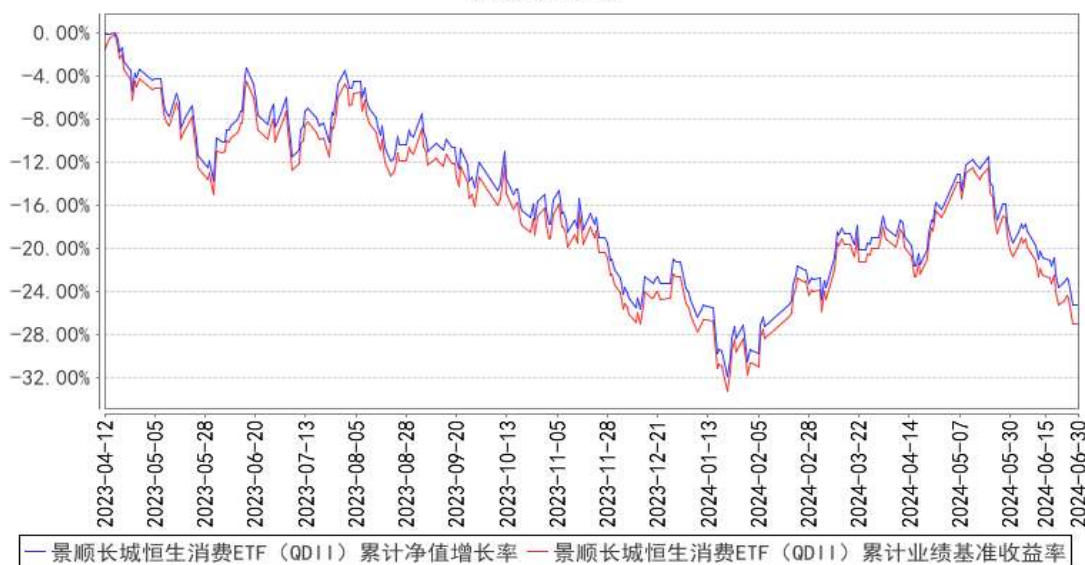
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.18%	1.04%	-7.86%	1.09%	0.68%	-0.05%
过去三个月	-7.73%	1.34%	-8.80%	1.39%	1.07%	-0.05%
过去六个月	-5.13%	1.51%	-5.72%	1.56%	0.59%	-0.05%
过去一年	-18.59%	1.45%	-19.43%	1.51%	0.84%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-25.27%	1.44%	-27.02%	1.50%	1.75%	-0.06%

#### 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

景顺长城恒生消费ETF (QDII) 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：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的建仓期为自 2023 年 4 月 12 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。报告期末距离建仓结束期未满足一年。

### 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 2024 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 184 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		
汪洋	本基金的基金经理	2023 年 4 月 12 日	-	16 年	理学硕士。曾任美国 KeyBank 利率衍生品部首席数量分析师，华泰联合证券股份有限公司金融工程部高级研究员，华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，汇添富基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理，博时基金管理有限公司指数与量化投资部副总经理兼基金经理。2021 年 10 月加入本公司，担任 ETF 与创新投资部总经理，自 2022 年 5 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理，现任 ETF 与创新投资部总经理、基金经理。具有 16 年证券、基金行业从业经验。



金璜	本基金的基金经理	2023 年 9 月 12 日	-	8 年	工学硕士，CFA。曾任美国 Altfest Personal Wealth Management (艾福斯特个人财富管理) 投资部量化研究员，Morgan Stanley (美国摩根士丹利) 风险管理部信用风险分析员。2018 年 7 月加入本公司，历任风险管理部经理、ETF 与创新投资部研究员、ETF 与创新投资部基金经理助理，自 2023 年 9 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 8 年证券、基金行业从业经验。
张 晓 南	本基金的基金经理	2023 年 5 月 13 日	2024 年 5 月 29 日	14 年	经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020 年 2 月加入本公司，自 2020 年 4 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 14 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

#### 4.3 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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 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 9 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。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

得益于海外宏观流动性环境改善以及多重对港政策的利好，港股市场上半年呈现震荡上行态势。主要海外市场指数中，纳斯达克科技市值加权(33.60%)>费城半导体指数(31.06%)>纳斯达克 100(16.98%)>标普 500(14.48%)>英国富时 100(5.57%)>恒生指数(3.94%)>道琼斯工业指数(3.79%)>罗素 2000 指数(1.02%)>恒生科技(-5.57%)。

在最近一次的美联储议息会议上，美联储表示通胀已经实质性地放缓。美国 5 月 CPI 同比增长 3.3%，低于预期和前值 3.4%，为近两年来的最低水平；5 月 CPI 环比持平，为 2022 年 7 月以来最低水平。5 月核心 CPI 同比增长 3.4%，低于预期 3.5% 及前值 3.6%，为三年多以来的最低水平；核心 CPI 环比增长 0.2%，预期为持平于 0.3%。数据公布后，市场完全消化了美联储今年降息两次的预期，9 月降息的概率增至七成，11 月降息的可能性达到 100%。同时，日元近期急速下行亦有助于亚太资金回流香港。受全球流动性宽松预期加强刺激，港股市场交易情绪获得明显提振。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年上半年，本基金份额净值增长率为-5.13%，业绩比较基准收益率为-5.72%。

### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

AH 溢价指数水平处于历史高位，表明港股相对 A 股的折价率依然处于较高水平，结合港股估值仍处于历史较低位置，长期来看，随着盈利能力改善及估值中枢的抬升，港股市场的配置价值有望得到进一步提振。数据表明，港股非必须性消费及必须性消费估值均处于历史较低分位，具备较厚安全垫。同时，随着消费需求在相关政策的推动下进一步释放，下半年港股消费板块具备一定吸引力。

本基金采用复制标的指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。在报告期内，本基金结合申购赎回情况、标的指数成分调整情况定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

#### 4.7 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。

相关定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 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。

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

无。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

## 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	10,791,460.19	6,157,508.14
结算备付金		125.33	943.11
存出保证金		16,319.38	0.46
交易性金融资产	6.4.7.2	193,746,012.18	236,867,382.21
其中：股票投资		193,746,012.18	236,867,382.21
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		2,233,750.10	3,100,766.22
应收股利		1,200,567.05	114,523.07

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		207,988,234.23	246,241,123.21
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,083.38	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		87,814.06	103,542.24
应付托管费		26,344.20	31,062.67
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	8,311,022.75	3,476,425.52
负债合计		8,426,264.39	3,611,030.43
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	267,041,000.00	308,041,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-67,479,030.16	-65,410,907.22
净资产合计		199,561,969.84	242,630,092.78
负债和净资产总计		207,988,234.23	246,241,123.21

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.7473 元，基金份额总额 267,041,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年4月12日（基金 合同生效日）至2023年6 月30日
<b>一、营业总收入</b>		-9,686,982.07	-49,835,873.75
1. 利息收入		19,359.12	203,974.31
其中：存款利息收入	6.4.7.13	19,359.12	203,974.31

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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-15,784,967.48	-20,184,292.81
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-18,521,714.08	-24,093,038.80
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	2,736,746.60	3,908,745.99
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）	6.4.7.21	5,378,160.02	-30,391,398.51
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		983,609.34	-183,468.26
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	-283,143.07	719,311.52
<b>减：二、营业总支出</b>		924,628.35	772,464.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	568,378.71	524,509.58
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	170,513.57	157,352.93
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	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.24	185,736.07	90,602.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-10,611,610.42	-50,608,338.72
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-10,611,610.42	-50,608,338.72
<b>五、其他综合收益的税后</b>		-	-

净额			
六、综合收益总额		-10,611,610.42	-50,608,338.72

### 6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	308,041,000.00	-	-65,410,907.22	242,630,092.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	308,041,000.00	-	-65,410,907.22	242,630,092.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-41,000,000.00	-	-2,068,122.94	-43,068,122.94
（一）、综合收益总额	-	-	-10,611,610.42	-10,611,610.42
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-41,000,000.00	-	8,543,487.48	-32,456,512.52
其中：1. 基金申购款	67,000,000.00	-	-11,849,533.89	55,150,466.11
2. 基金赎回款	-108,000,000.00	-	20,393,021.37	-87,606,978.63
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产	267,041,000.00	-	-67,479,030.16	199,561,969.84
项目	上年度可比期间			
	2023 年 4 月 12 日 (基金合同生效日) 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	-	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	647,041,000.00	-	-	647,041,000.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-283,000,000.00	-	-29,862,990.05	-312,862,990.05
(一)、综合收益总额	-	-	-50,608,338.72	-50,608,338.72
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-283,000,000.00	-	20,745,348.67	-262,254,651.33
其中: 1. 基金申购款	11,000,000.00	-	-1,117,474.28	9,882,525.72
2. 基金赎回款	-294,000,000.00	-	21,862,822.95	-272,137,177.05
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	364,041,000.00	-	-29,862,990.05	334,178,009.95

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:



康乐

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(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[2023]第 351 号《关于准予景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的批复》注册,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《景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 647,041,000.00 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(2023)第 0222 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》于 2023 年 4 月 12 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 647,041,000.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司,境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]第 84 号文审核同意,本基金 647,041,000.00 份基金份额于 2023 年 4 月 21 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数恒生消费指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要投资于标的指数成份股、备选成份股,投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不少于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。其余资产可投资于其他金融产品或工具;境外投资工具包括:已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金;已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券以及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品;远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品;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

须符合中国证监会相关规定。境内投资工具包括：本基金可少量投资于部分非成份股(包含港股通标的股票、主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、衍生工具(股指期货、股票期权)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、公开发行的次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、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)。本基金可通过合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度或港股通机制投资香港市场股票。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为：恒生消费指数收益率(使用估值汇率折算)。

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

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2024 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》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 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 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[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[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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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(如适用)起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。对基金通过沪港通或深港通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) 基金通过沪港通或深港通买卖、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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	10,791,460.19
等于：本金	10,790,999.18
加：应计利息	461.01
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	10,791,460.19

注：于2024年6月30日，银行存款中包含的外币余额为：港币812,577.58元（折合人民币741,623.31元）。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	243,540,101.07	-	193,746,012.18	-49,794,088.89
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	243,540,101.07	-	193,746,012.18	-49,794,088.89
----	----------------	---	----------------	----------------

注：于 2024 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 0.00 元。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金本报告期末债权投资余额为零。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末债权投资余额为零。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

### 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

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

## 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	69,606.39
其中：交易所市场	69,606.39
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	174,042.96
应退替代款	8,067,373.40
合计	8,311,022.75

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	308,041,000.00	308,041,000.00
本期申购	67,000,000.00	67,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-108,000,000.00	-108,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	267,041,000.00	267,041,000.00

## 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	-29,817,119.23	-35,593,787.99	-65,410,907.22
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-29,817,119.23	-35,593,787.99	-65,410,907.22
本期利润	-15,989,770.44	5,378,160.02	-10,611,610.42
本期基金份额交易产生的变动数	5,630,008.10	2,913,479.38	8,543,487.48
其中：基金申购款	-9,348,090.49	-2,501,443.40	-11,849,533.89
基金赎回款	14,978,098.59	5,414,922.78	20,393,021.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-40,176,881.57	-27,302,148.59	-67,479,030.16

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		10,700.11
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		8,518.76
其他		140.25
合计		19,359.12

#### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-18,521,714.08
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		-18,521,714.08

##### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		126,440,409.28
减：卖出股票成本总额		144,583,761.77
减：交易费用		378,361.59
买卖股票差价收入		-18,521,714.08

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	87,606,978.63
减：现金支付赎回款总额	87,606,978.63
减：赎回股票成本总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

#### 6.4.7.14.4 股票投资收益——证券出借收入

无。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

#### 6.4.7.19 衍生工具收益

##### 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。



## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,736,746.60
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	2,736,746.60

## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	5,378,160.02
股票投资	5,378,160.02
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	5,378,160.02

注：本基金本报告期公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益0.00元。

## 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-283,143.07
合计	-283,143.07

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申赎本基金时，补入（卖出）被替代成分券的实际买入（卖出）成本与申赎确认日估值的差额，或强制退款的被替代成分券在强制退款计算日与申赎确认日估值的差额。

## 6.4.7.23 信用减值损失

无。

## 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,601.78
IOPV 数据费	9,944.48
注册登记费	74,590.88
证券组合费	7,091.33
合计	185,736.07

## 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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
布朗兄弟哈里曼银行	境外资产托管人
景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）（“景顺长城恒生消费 ETF 联接（QDII）”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

## 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年4月12日（基金合同生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	568,378.71	524,509.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	68,946.84	10,050.40
应支付基金管理人的净管理费	499,431.87	514,459.18

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 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 × 0.5% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年4月12日（基金合同生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	170,513.57	157,352.93

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 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未与关联方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未与关联方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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例(%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%)
景顺长城恒生消费ETF联接基金	24,579,700.00	9.20	16,078,700.00	5.22

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年4月12日(基金合同生效日)至2023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
布朗兄弟哈里曼银行	741,623.31	-	1,018,432.50	-
兴业银行	10,049,836.88	10,700.11	15,565,609.64	171,916.30

注：本基金的活期银行存款由基金托管人和境外资产托管人保管，并按银行间同业利率或约定利率计息。

#### 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

本基金本报告期无利润分配。

#### 6.4.12 期末(2024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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
3331 HK	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	2024 年 4 月 3 日	重大 事项 停牌	21.40	-	-	55,000	1,067,533.33	1,177,129.03	-
6689 HK	CHONGQING HONGJIU FRUIT CO-H	2024 年 3 月 20 日	重大 事项 停牌	1.59	-	-	136,100	438,957.24	216,135.40	-

注：1、根据维达国际控股有限公司于 2024 年 8 月 15 日发布的《法国巴黎证券（亚洲）有限公司及中国国际金融香港证券有限公司为及代表要约人就维达国际控股有限公司的全部已发行股份（要约人及要约人一致行动人士已经拥有的该等股份除外）作出自愿无条件现金要约（1）完成强制性收购及（2）撤销股份上市地位》的公告，VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS 触及股票终止上市情形，股份于香港联交所的上市地位经批准将于 2024 年 8 月 16 日起撤回。

2、本基金截至 2024 年 6 月 30 日持有因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票 CHONGQING HONGJIU FRUIT CO-H，将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 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 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金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。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券（上年度末：同）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票,不得超过该上市公司可流通股股票的 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 2024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							
货币资金	10,791,460.19	-	-	-	-	-	10,791,460.19
结算备付金	125.33	-	-	-	-	-	125.33
存出保证金	16,319.38	-	-	-	-	-	16,319.38
交易性金融资产	-	1,177,129.03	-	-	-	192,568,883.15	193,746,012.18
应收股利	-	-	-	-	-	1,200,567.05	1,200,567.05
应收清算款	-	-	-	-	-	2,233,750.10	2,233,750.10
资产总计	10,807,904.90	1,177,129.03	-	-	-	196,003,200.30	207,988,234.23
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	87,814.06	87,814.06
应付托管费	-	-	-	-	-	26,344.20	26,344.20
应付清算款	-	-	-	-	-	1,083.38	1,083.38
其他负债	-	-	-	-	-	8,311,022.75	8,311,022.75
负债总计	-	-	-	-	-	8,426,264.39	8,426,264.39
利率敏感度缺口	10,807,904.90	1,177,129.03	-	-	-	-	-
上年度末 2023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							
货币资金	6,157,508.14	-	-	-	-	-	6,157,508.14
结算备付金	943.11	-	-	-	-	-	943.11
存出保证金	0.46	-	-	-	-	-	0.46
交易性金融资产	-	-	-	-	-	236,867,382.21	236,867,382.21
应收股利	-	-	-	-	-	114,523.07	114,523.07
应收清算款	-	-	-	-	-	3,100,766.22	3,100,766.22
资产总计	6,158,451.71	-	-	-	-	240,082,671.50	246,241,123.21
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	103,542.24	103,542.24
应付托管费	-	-	-	-	-	31,062.67	31,062.67
其他负债	-	-	-	-	-	3,476,425.52	3,476,425.52



负债总计	-	-	-	-	-	3,611,030.43	3,611,030.43
利率敏感度缺口	6,158,451.71	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	741,623.31	-	741,623.31
交易性金融资产	-	193,746,012.18	-	193,746,012.18
应收清算款	-	188,416.75	-	188,416.75
资产合计	-	194,676,052.24	-	194,676,052.24
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	194,676,052.24	-	194,676,052.24
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	3,942,211.69	-	3,942,211.69
交易性金融资产	-	236,867,382.21	-	236,867,382.21
应收股利	45,054.47	23,597.97	-	68,652.44
应收清算款	-	241,921.98	-	-
资产合计	45,054.47	241,075,113.85	-	241,120,168.32
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	45,054.47	241,075,113.85	-	241,120,168.32

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	9,733,802.61	12,056,008.42
所有外币相对人民币贬值5%	-9,733,802.61	-12,056,008.42	

## 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 2024年6月30日		上年度末 2023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	193,746,012.18	97.09	236,867,382.21	97.62
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	193,746,012.18	97.09	236,867,382.21	97.62

## 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 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
沪深 300 指数上升 5%	8,461,908.12	10,342,833.53
沪深 300 指数下降 5%	-8,461,908.12	-10,342,833.53

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	192,352,747.75	236,867,382.21
第二层次	1,393,264.43	-
第三层次	-	-
合计	193,746,012.18	236,867,382.21

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资, 若出现交易不活跃、非公开发行等情况, 本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次, 并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次, 确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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	193,746,012.18	93.15
	其中：普通股	193,746,012.18	93.15
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,791,585.52	5.19
8	其他各项资产	3,450,636.53	1.66
9	合计	207,988,234.23	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 176,093,256.80 元，占基金资产净值的比例为 88.24%。

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	193,746,012.18	97.09
合计	193,746,012.18	97.09

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

#### 7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
------	------	---------------

原材料	359,915.36	0.18
周期性消费品	95,861,991.22	48.04
非周期性消费品	62,666,631.29	31.40
综合	-	-
能源	-	-
金融	-	-
基金	-	-
工业	20,224,751.50	10.13
信息科技	351,958.61	0.18
公用事业	-	-
通讯	12,887,499.77	6.46
合计	192,352,747.75	96.39

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
原材料	-	-
周期性消费品	-	-
非周期性消费品	1,393,264.43	0.70
综合	-	-
能源	-	-
金融	-	-
基金	-	-
工业	-	-
信息科技	-	-
公用事业	-	-
通讯	-	-
合计	1,393,264.43	0.70

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

#### 7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	创科实业有限公司	669 HK	香港联合交易所	中国香港	244,000	19,864,297.66	9.95
2	ANTA SPORTS PRODUCT	安踏体育用品有限公司	2020 HK	香港联合交易所	中国香港	240,000	16,428,240.00	8.23

	S LTD							
3	YUM CHINA HOLDINGS INC	百胜中国控股有限公司	9987 HK	香港联合交易所	中国香港	66,800	14,717,439.59	7.37
4	NONGFU SPRING CO LTD-H	农夫山泉股份有限公司	9633 HK	香港联合交易所	中国香港	341,400	11,544,370.67	5.78
5	TRIP.COM GROUP LTD	携程集团有限公司	9961 HK	香港联合交易所	中国香港	28,950	9,897,713.42	4.96
6	HAIER SMART HOME CO LTD-H	海尔智家股份有限公司	6690 HK	香港联合交易所	中国香港	412,000	9,814,230.58	4.92
7	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	申洲国际集团控股有限公司	2313 HK	香港联合交易所	中国香港	140,200	9,782,368.92	4.90
8	CHINA MENGNIU DAIRY CO	中国蒙牛乳业有限公司	2319 HK	香港联合交易所	中国香港	533,000	6,810,418.16	3.41
9	WH GROUP LTD	万洲国际有限公司	288 HK	香港联合交易所	中国香港	1,414,000	6,633,321.73	3.32
10	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	华润啤酒(控股)有限公司	291 HK	香港联合交易所	中国香港	275,000	6,588,408.75	3.30
11	LI NING CO LTD	李宁有限公司	2331 HK	香港联合交易所	中国香港	394,500	6,084,883.19	3.05
12	PRADA S. P. A.	普拉达	1913 HK	香港联合交易所	中国香港	108,500	5,783,105.55	2.90
13	SAMSONITE INTERNATIONAL SA	新秀丽国际有限公司	1910 HK	香港联合交易所	中国香港	247,200	5,256,817.76	2.63
14	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	青岛啤酒股份有限公司	168 HK	香港联合交易所	中国香港	104,000	4,945,265.31	2.48
15	POP MART INTERNATIONAL	泡泡玛特国际集团	9992 HK	香港联合交易所	中国香港	114,000	3,979,741.14	1.99

	TIONAL GROUP	有限公司						
16	HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	海底捞国际控股有限公司	6862 HK	香港联合交易所	中国香港	284,000	3,639,183.72	1.82
17	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	中国旺旺控股有限公司	151 HK	香港联合交易所	中国香港	801,000	3,450,587.53	1.73
18	SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	思摩尔国际控股有限公司	6969 HK	香港联合交易所	中国香港	365,000	3,154,724.05	1.58
19	TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	同程旅行控股有限公司	780 HK	香港联合交易所	中国香港	210,800	2,989,786.35	1.50
20	MINISO GROUP HOLDINGS LTD	名创优品集团控股有限公司	9896 HK	香港联合交易所	中国香港	85,800	2,932,632.50	1.47
21	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	波司登国际控股有限公司	3998 HK	香港联合交易所	中国香港	648,000	2,880,199.04	1.44
22	TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	康师傅控股有限公司	322 HK	香港联合交易所	中国香港	334,000	2,868,498.48	1.44
23	BUDWEISER BREWING CO APACALTD	百威亚太控股有限公司	1876 HK	香港联合交易所	中国香港	336,800	2,827,993.74	1.42
24	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP	周大福珠宝集团有限公司	1929 HK	香港联合交易所	中国香港	338,600	2,611,332.64	1.31
25	HENGAN INTL GROUP CO	恒安国际集团有限公司	1044 HK	香港联合交易所	中国香港	118,500	2,574,031.40	1.29

	LTD							
26	CHINA FEIHE LTD	中国飞鹤有限公司	6186 HK	香港联合交易所	中国香港	769,000	2,533,681.82	1.27
27	L' OCCITANE INTERNATIONAL SA	L' OCCITANE	973 HK	香港联合交易所	中国香港	75,250	2,280,148.44	1.14
28	H WORLD GROUP LTD	华住集团有限公司	1179 HK	香港联合交易所	中国香港	83,100	1,971,936.41	0.99
29	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	裕元工业(集团)有限公司	551 HK	香港联合交易所	中国香港	137,000	1,888,061.12	0.95
30	TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	滔搏国际控股有限公司	6110 HK	香港联合交易所	中国香港	473,000	1,791,545.21	0.90
31	ZJLD GROUP INC	珍酒李渡集团有限公司	6979 HK	香港联合交易所	中国香港	201,200	1,483,740.23	0.74
32	UNI-PRESENT CHINA HOLDINGS	统一企业中国控股有限公司	220 HK	香港联合交易所	中国香港	220,000	1,431,629.85	0.72
33	FIRST PACIFIC CO	第一太平有限公司	142 HK	香港联合交易所	中国香港	396,000	1,311,959.25	0.66
34	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华控股有限公司	1999 HK	香港联合交易所	中国香港	263,200	1,287,565.14	0.65
35	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	颐海国际控股有限公司	1579 HK	香港联合交易所	中国香港	106,000	1,267,347.45	0.64
36	XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	特步国际控股有限公司	1368 HK	香港联合交易所	中国香港	246,500	1,082,132.73	0.54
37	LUK FOOK	六福集团	590 HK	香港联合交易所	中国香港	59,000	894,955.75	0.45



	HOLDING S INTL LTD	(国际) 有限公司		交易所				
38	VITASOY INTL HOLDING S LTD	维他奶国际集团有限公司	345 HK	香港联合交易所	中国香港	156,000	840,030.67	0.42
39	CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	中国旅游集团中免股份有限公司	1880 HK	香港联合交易所	中国香港	16,800	733,685.20	0.37
40	SUN ART RETAIL GROUP LTD	高鑫零售有限公司	6808 HK	香港联合交易所	中国香港	485,500	660,228.15	0.33
41	JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	九毛九国际控股有限公司	9922 HK	香港联合交易所	中国香港	159,000	587,720.29	0.29
42	JS GLOBAL LIFESTYLE CO LTD	JS 环球生活有限公司	1691 HK	香港联合交易所	中国香港	265,500	373,167.47	0.19
43	CHERVON HOLDING S LTD	泉峰控股有限公司	2285 HK	香港联合交易所	中国香港	21,700	360,453.84	0.18
44	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	华宝国际控股有限公司	336 HK	香港联合交易所	中国香港	165,000	359,915.36	0.18
45	HAICHANG OCEAN PARK HOLDING S	海昌海洋公园控股有限公司	2255 HK	香港联合交易所	中国香港	551,000	352,020.68	0.18
46	KEEP INC	Keep Inc	3650 HK	香港联合交易所	中国香港	62,400	351,958.61	0.18
47	FOSUN TOURISM GROUP	复星旅游文化集团	1992 HK	香港联合交易所	中国香港	52,800	174,446.00	0.09
48	HELENS INTERNATIONAL	海伦司国际控股有限公司	9869 HK	香港联合交易所	中国香港	75,500	154,352.44	0.08

	HOLDING							
49	MOG DIGITECH HOLDINGS LTD	马可数字科技控股有限公司	1942 HK	香港联合交易所	中国香港	132,000	120,473.76	0.06

注：本基金对以上证券代码采用彭博代码即 BB Ticker。

#### 7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	维达国际控股有限公司	3331 HK	香港联合交易所	中国香港	55,000	1,177,129.03	0.59
2	CHONGQING HONGJIU FRUIT CO-H	重庆洪九果品股份有限公司	6689 HK	香港联合交易所	中国香港	136,100	216,135.40	0.11

注：本基金对以上证券代码采用彭博代码即 BB Ticker。

#### 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

##### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	YUM CHINA HOLDINGS INC	9987 HK	9,865,252.66	4.07
2	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	669 HK	9,806,000.58	4.04
3	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	2020 HK	7,836,368.77	3.23
4	NONGFU SPRING CO LTD-H	9633 HK	5,712,349.11	2.35
5	HAIER SMART HOME CO LTD-H	6690 HK	4,045,130.86	1.67
6	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	4,037,188.23	1.66
7	MINISO GROUP HOLDING LTD	9896 HK	3,747,547.40	1.54

8	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	291 HK	3,609,833.01	1.49
9	CHINA MENGNIU DAIRY CO	2319 HK	3,578,260.11	1.47
10	LI NING CO LTD	2331 HK	3,037,425.04	1.25
11	TRIP.COM GROUP LTD	9961 HK	2,951,121.93	1.22
12	WH GROUP LTD	288 HK	2,902,832.61	1.20
13	SAMSONITE INTERNATIONAL SA	1910 HK	2,546,995.93	1.05
14	ZJLD GROUP INC	6979 HK	2,257,040.47	0.93
15	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	168 HK	2,059,582.58	0.85
16	H Aidilao INTERNATIONAL HOLDI	6862 HK	1,915,598.87	0.79
17	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	1876 HK	1,504,589.58	0.62
18	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1929 HK	1,479,842.93	0.61
19	CHINA FEIHE LTD	6186 HK	1,333,711.27	0.55
20	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	151 HK	1,325,669.88	0.55

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。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	TECHTRONIC INDU STRIES CO LTD	669 HK	15,569,186.49	6.42
2	YUM CHINA HOLDINGS INC	9987 HK	12,432,489.07	5.12
3	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	2020 HK	10,797,354.90	4.45
4	NONGFU SPRING CO LTD-H	9633 HK	7,992,262.45	3.29
5	HAIER SMART HOME CO LTD-H	6690 HK	5,746,665.37	2.37
6	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	5,541,952.32	2.28
7	CHINA MENGNIU DAIRY CO	2319 HK	5,070,334.42	2.09
8	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	291 HK	5,049,658.45	2.08

9	LI NING CO LTD	2331 HK	4,406,409.97	1.82
10	WH GROUP LTD	288 HK	4,039,874.16	1.67
11	SAMSONITE INTERNATIONAL SA	1910 HK	3,678,522.65	1.52
12	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	168 HK	2,980,804.20	1.23
13	H Aidilao International Holdi	6862 HK	2,566,815.20	1.06
14	TRIP.COM GROUP LTD	9961 HK	2,523,971.41	1.04
15	TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	780 HK	2,309,819.94	0.95
16	PRADA S. P. A.	1913 HK	2,231,640.14	0.92
17	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	1876 HK	2,122,242.77	0.87
18	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1929 HK	2,046,043.34	0.84
19	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	151 HK	1,887,721.22	0.78
20	POP MART INTERNATIONAL GROUP	9992 HK	1,807,944.83	0.75

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	96,082,346.42
卖出收入（成交）总额	126,440,409.28

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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	16,319.38
2	应收清算款	2,233,750.10
3	应收股利	1,200,567.05
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	3,450,636.53

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	公司名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	3331 HK	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	1,177,129.03	0.59	重大事项停牌
2	6689 HK	CHONGQING HONGJIU FRUIT CO-H	216,135.40	0.11	重大事项停牌

### 7.11.6 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		兴业银行股份有限公司- 景顺长城恒生消费交易 型开放式指数证券投资 基金发起式联接基金 (QDII)	
		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
2,908	91,829.78	73,532,090.00	27.54	168,929,210.00	63.26	24,579,700.00	9.20

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	BARCLAYS BANK PLC	41,000,090.00	15.35
2	兴业银行股份有限公司-景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	24,579,700	9.20
3	中卓(北京)私募基金管理有限公司-中卓恒发1号私募证券投资基金	6,927,500	2.59
4	天津市华谊网络通信技术有限公司	4,890,200	1.83
5	张舰文	4,408,000	1.65
6	郭楷	4,000,000	1.50
7	张穗燕	3,300,000	1.24
8	王义波	3,161,100	1.18
9	诸东平	2,600,000	0.97
10	吴剑波	2,593,000	0.97
11	郑玉环	2,305,000	0.86

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

1. 本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研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。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 4 月 12 日） 基金份额总额	647,041,000.00
本报告期期初基金份额总额	308,041,000.00
本报告期基金总申购份额	67,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	108,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	267,041,000.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

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 (%)	
兴业证券股份有限公司	2	127,010,215.68	57.08	101,607.90	87.64	-
UBS Securities Asia Limited	2	80,531,258.56	36.19	12,079.76	10.42	-
Haitong International Securities Company Limited	1	9,209,562.57	4.14	1,381.46	1.19	-
China International Capital Corporation Limited	1	5,771,718.89	2.59	865.79	0.75	-
J.P. MORGAN Securities (Asia Pacific) Limited	1	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、本基金本期交易单元未发生变更。

## 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
J.P. MORGAN Securities (Asia	-	-	-	-	-	-	-	-

Pacific) Limited								
山西证券股份 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部分基金 2024 年非港股通交易日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回及转换业务安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 4 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 10 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 22 日
4	景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 22 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增湘财证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 2 月 29 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	2024 年 3 月 22 日
7	关于警惕假冒景顺长城基金 APP 开展诈骗活动的声明	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 27 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 27 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 28 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日
11	景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2023 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 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	2024 年 4 月 13 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	2024 年 4 月 15 日
14	景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2024 年第 1 季	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日

	度报告		
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 13 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增渤海证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 20 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	2024 年 5 月 24 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 30 日
20	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	2024 年 5 月 31 日
21	景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2024 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 3 日
22	景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 3 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 18 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增联储证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 20 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增爱建证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 21 日
26	景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 21 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 27 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	2024 年 6 月 29 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	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	持有基金份额比例达	期初	申购	赎回	持有份额	份额占

者类别	号	到或者超过 20%的时间区间	份额	份额	份额		比 (%)
机构	1	20240205-20240304; 20240606-20240606	42,243,900.00	103,883,900.00	105,127,710.00	41,000,090.00	15.35

#### 产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：

##### 1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

##### 2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）募集注册的文件；

2、《景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》；

3、《景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》；

4、《景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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

2024 年 8 月 30 日