

# 景顺长城量化精选股票型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	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 .....	7
<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 .....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	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 .....	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表 .....	11
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 .....	16
<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 .....	38
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 .....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	53

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 .....	54
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 .....	54
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 .....	54
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 .....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	54
7.12 投资组合报告附注 .....	54
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
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 .....	56
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录 .....	61
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化精选股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城量化精选股票
场内简称	无
基金主代码	000978
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月4日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	389,957,505.23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精选股票，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略：本基金股票资产占基金资产的比例范围为80%-95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略：本基金主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。</p> <p>3、债券投资策略：出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p>
业绩比较基准	中证500指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%。
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	021-60637228
传真	0755-22381339	021-60635778

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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	李进	田国立

## 2.4 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

## 2.5 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	-18,270,523.19
本期利润	-42,107.85
加权平均基金份额本期利润	-0.0001
本期加权平均净值利润率	-0.01%
本期基金份额净值增长率	-0.67%
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	241,294,622.26
期末可供分配基金份额利润	0.6188
期末基金资产净值	631,252,127.49
期末基金份额净值	1.619
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	68.64%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

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

低于所列数字。

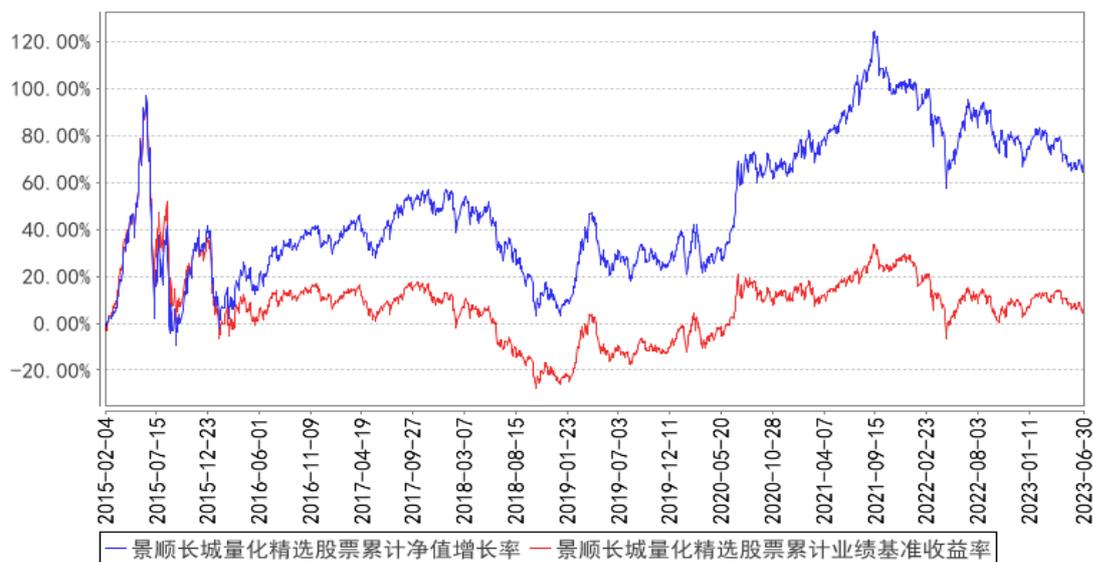
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.94%	0.82%	-0.77%	0.89%	1.71%	-0.07%
过去三个月	-4.54%	0.76%	-5.10%	0.78%	0.56%	-0.02%
过去六个月	-0.67%	0.75%	2.20%	0.75%	-2.87%	0.00%
过去一年	-12.20%	0.91%	-6.65%	0.91%	-5.55%	0.00%
过去三年	17.15%	1.13%	2.48%	1.13%	14.67%	0.00%
自基金合同生效起至今	68.64%	1.68%	6.40%	1.55%	62.24%	0.13%

### 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

景顺长城量化精选股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例范围为 80%—95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%—20%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为 0—3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2015 年 2 月 4 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	2015年2月4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、《景顺长城量化精选股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 17 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，国内经济整体呈现出弱复苏的态势，服务业的复苏较为明显，制造业和地产的复苏仍需观察，权益市场的表现也反映了较弱的经济和基本面预期。从国内来看，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 49.2、48.8、49.0，今年前 5 个月工业增加值累计同比增长 3.6%，其中 5 月份工业增加值当月同比增长 3.5%，经济复苏的节奏出现放缓的迹象。6 月 PPI 同比下降 5.4%，环比下降 0.8%；CPI 同比持平，环比下降 0.2%，通胀依旧温和。6 月 M2 同比增长 11.3%，M1 同比增速 3.1%，流动性充裕；6 月末外汇储备 3.19 万亿美元，汇率短期承压。整体而言，国内货币政策总体保持稳健，流动性充裕，宏观环境总体温和，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-0.67%，业绩比较基准收益率为 2.20%。

#### 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。风格上，估值和成长相对均衡的中盘股以及细分行业的龙头股仍然值得期待。我们的投资组合仍然会维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生长期投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：景顺长城量化精选股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	44,656,655.73	44,256,450.26
结算备付金		3,425,812.57	5,105,701.07
存出保证金		193,372.24	220,398.55
交易性金融资产	6.4.7.2	586,800,779.34	700,276,377.87

其中：股票投资		586,193,735.59	700,276,377.87
基金投资		-	-
债券投资		607,043.75	-
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		310,651.93	325,434.60
应收股利		-	-
应收申购款		82,086.24	333,312.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		635,469,358.05	750,517,674.83
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		711,799.12	1,107,767.77
应付管理人报酬		773,829.27	946,024.56
应付托管费		128,971.52	157,670.79
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.34	0.14
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,602,629.31	4,158,852.79
负债合计		4,217,230.56	6,370,316.05
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	389,957,505.23	456,489,143.72
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	241,294,622.26	287,658,215.06
净资产合计		631,252,127.49	744,147,358.78
负债和净资产总计		635,469,358.05	750,517,674.83

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.619 元，基金份额总额 389,957,505.23 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化精选股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		6,266,790.77	-36,709,635.60
1. 利息收入		119,286.99	132,028.52
其中：存款利息收入	6.4.7.13	119,286.99	132,028.52
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）		-12,178,095.13	-83,193,367.76
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-20,262,275.88	-91,113,633.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	313,941.23	404,705.85
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-190,528.59
股利收益	6.4.7.19	7,770,239.52	7,706,088.39
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	18,228,415.34	46,018,799.17
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	97,183.57	332,904.47
<b>减：二、营业总支出</b>		6,308,898.62	6,607,182.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,312,401.13	5,560,012.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	885,400.12	926,668.71

3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		0.77	-907.14
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	111,096.60	121,408.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-42,107.85	-43,316,817.63
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-42,107.85	-43,316,817.63
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-42,107.85	-43,316,817.63

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城量化精选股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	456,489,143.72	-	287,658,215.06	744,147,358.78
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）	456,489,143.72	-	287,658,215.06	744,147,358.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-66,531,638.49	-	-46,363,592.80	-112,895,231.29
（一）、综合收益总额	-	-	-42,107.85	-42,107.85
（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）	-66,531,638.49	-	-46,321,484.95	-112,853,123.44

其中：1. 基金申购款	23,570,587.54	-	16,211,566.39	39,782,153.93
2. 基金赎回款	-90,102,226.03	-	-62,533,051.34	-152,635,277.37
(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)	389,957,505.23	-	241,294,622.26	631,252,127.49
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	433,972,422.96	-	416,581,992.04	850,554,415.00
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)	433,972,422.96	-	416,581,992.04	850,554,415.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-225,474.26	-	-50,590,348.56	-50,815,822.82
(一)、综合收益总额	-	-	-43,316,817.63	-43,316,817.63
(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)	-225,474.26	-	-7,273,530.93	-7,499,005.19
其中：1. 基金申购款	106,842,074.53	-	77,884,863.45	184,726,937.98
2. 基金赎回款	-107,067,548.79	-	-85,158,394.38	-192,225,943.17
(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)	433,746,948.70	-	365,991,643.48	799,738,592.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城量化精选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]1366 号文《关于准予景顺长城量化精选股票型证券投资基金注册的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化精选股票型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2015 年 2 月 4 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,407,431,598.88 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 442,601.36 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,407,874,200.24 元，折合 1,407,874,200.24 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、债券（含中小企业私募债）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 80%-95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-20%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为 0-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券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。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2023 年 8 月 28 日批准报出。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 6.4.6 税项

### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题

的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## （2）增值税及附加

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

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

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

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

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

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

## （3）企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题

的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

#### (4) 个人所得税

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

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

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

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

### 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	44,656,655.73
等于：本金	44,652,919.81
加：应计利息	3,735.92
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	44,656,655.73

#### 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	600,626,364.19	-	586,193,735.59	-14,432,628.60
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	43.75	607,043.75	0.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	43.75	607,043.75	0.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	601,233,364.19	43.75	586,800,779.34	-14,432,628.60

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末的买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	945.51
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,498,004.85
其中：交易所市场	2,498,004.85
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	103,678.95
合计	2,602,629.31

## 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	456,489,143.72	456,489,143.72
本期申购	23,570,587.54	23,570,587.54
本期赎回 (以“-”号填列)	-90,102,226.03	-90,102,226.03
本期末	389,957,505.23	389,957,505.23

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	431,843,217.18	-144,185,002.12	287,658,215.06
本期利润	-18,270,523.19	18,228,415.34	-42,107.85
本期基金份额交易产生的变动数	-63,614,038.09	17,292,553.14	-46,321,484.95
其中：基金申购款	22,200,351.67	-5,988,785.28	16,211,566.39
基金赎回款	-85,814,389.76	23,281,338.42	-62,533,051.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	349,958,655.90	-108,664,033.64	241,294,622.26

#### 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	81,701.62	
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	35,720.94	
其他	1,864.43	
合计	119,286.99	

#### 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	-20,262,275.88	
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	-20,262,275.88
----	----------------

#### 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	3,044,426,226.01
减：卖出股票成本总额	3,055,624,067.39
减：交易费用	9,064,434.50
买卖股票差价收入	-20,262,275.88

#### 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	211.10
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	313,730.13
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	313,941.23

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,730,973.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,417,000.00
减：应计利息总额	173.79
减：交易费用	69.30
买卖债券差价收入	313,730.13

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,770,239.52
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	7,770,239.52

## 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	18,228,415.34
股票投资	18,228,415.34
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	18,228,415.34

## 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	95,919.36
基金转换费收入	1,264.21
合计	97,183.57

#### 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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	2,358.95
其他	360.00
存托服务费	198.70
合计	111,096.60

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
长城证券	624,568.46	0.01	-	-

## 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	581.65	0.01	581.65	0.02
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	-	-	-	-

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

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	5,312,401.13
其中：支付销售机构的客户维护费	1,756,221.62	1,781,217.07

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	885,400.12	926,668.71

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务交易。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务交易。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

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

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国建设银行-活期	44,656,655.73	81,701.62	50,080,602.65	84,195.83

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,088	12,925.44	22,869.76	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月	1 个月	新股流	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-

		月 28 日	内(含)	通受限						
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月以上	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	131.11	53.24	261	34,219.71	13,895.64	-
301322	绿通科技	2023 年 5 月 25 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	-	53.24	131	-	6,974.44	转增股
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-

301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	966	22,961.82	41,431.74	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股流通受限	57.66	57.66	4,220	243,325.20	243,325.20	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	57.66	57.66	469	27,042.54	27,042.54	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	2,403	15,811.74	18,214.74	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	688	24,871.20	26,233.44	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月	6 个月	新股流	19.86	18.06	4,381	87,006.66	79,120.86	-

		月 24 日		通受限						
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,153	26,051.30	25,986.71	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	641	15,127.60	41,453.47	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	1,361	51,554.68	40,135.89	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	5.69	5.41	7,859	44,717.71	42,517.19	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	2,734	30,347.40	46,587.36	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688485	九州一轨	2023 年 1 月 11 日	6 个月	新股流通受限	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	152.38	135.97	271	41,294.98	36,847.87	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-

688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

#### 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
118036	力合转债	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	1,070	107,000.00	107,002.11	-
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	5,000	500,000.00	500,041.64	-

#### 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
601298	青岛港	2023 年 6 月 28 日	重大事项停牌	6.97	2023 年 7 月 3 日	7.40	152,600	1,113,099.15	1,063,622.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.1%（上年度末：0.00%）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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	44,656,655.73	-	-	-	-	-	44,656,655.73
结算备付金	3,425,812.57	-	-	-	-	-	3,425,812.57
存出保证金	193,372.24	-	-	-	-	-	193,372.24
交易性金融资产	-	-	-	-607,043.75	586,193,735.59	586,800,779.34	586,800,779.34
应收申购款	-	-	-	-	-	82,086.24	82,086.24
应收证券清算款	-	-	-	-	-	310,651.93	310,651.93
资产总计	48,275,840.54	-	-	-607,043.75	586,586,473.76	635,469,358.05	635,469,358.05
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	711,799.12	711,799.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	773,829.27	773,829.27
应付托管费	-	-	-	-	-	128,971.52	128,971.52
应交税费	-	-	-	-	-	1.34	1.34
其他负债	-	-	-	-	-	2,602,629.31	2,602,629.31
负债总计	-	-	-	-	-	4,217,230.56	4,217,230.56
利率敏感度缺口	48,275,840.54	-	-	-607,043.75	-	-	-
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	44,256,450.26	-	-	-	-	-	44,256,450.26
结算备付金	5,105,701.07	-	-	-	-	-	5,105,701.07
存出保证金	220,398.55	-	-	-	-	-	220,398.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-700,276,377.87	700,276,377.87	700,276,377.87
应收申购款	-	-	-	-	-	333,312.48	333,312.48
应收证券清算款	-	-	-	-	-	325,434.60	325,434.60
资产总计	49,582,549.88	-	-	-	-700,935,124.95	750,517,674.83	750,517,674.83
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,107,767.77	1,107,767.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	946,024.56	946,024.56

应付托管费	-	-	-	-	157,670.79	157,670.79
应交税费	-	-	-	-	0.14	0.14
其他负债	-	-	-	-	4,158,852.79	4,158,852.79
负债总计	-	-	-	-	6,370,316.05	6,370,316.05
利率敏感度缺口	49,582,549.88	-	-	-	-	-

#### 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 0.1%（上年度末：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	586,193,735.59	92.86	700,276,377.87	94.10
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	586,193,735.59	92.86	700,276,377.87	94.10

#### 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%	23,754,685.68	21,494,788.03
	沪深 300 指数下降 5%	-23,754,685.68	-21,494,788.03

#### 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	583,296,390.18	698,180,528.71
第二层次	2,317,796.19	-
第三层次	1,186,592.97	2,095,849.16
合计	586,800,779.34	700,276,377.87

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	586,193,735.59	92.25
	其中：股票	586,193,735.59	92.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	607,043.75	0.10
	其中：债券	607,043.75	0.10
	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	48,082,468.30	7.57
8	其他各项资产	586,110.41	0.09
9	合计	635,469,358.05	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	3,516,675.00	0.56
B	采矿业	35,119,472.20	5.56
C	制造业	350,037,315.89	55.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,389,806.02	3.55
E	建筑业	14,566,788.15	2.31
F	批发和零售业	11,866,306.17	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	9,179,218.00	1.45
H	住宿和餐饮业	5,080,495.00	0.80
I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,994,215.28	8.71
J	金融业	50,514,959.99	8.00
K	房地产业	5,111,739.00	0.81
L	租赁和商务服务业	4,580,745.00	0.73
M	科学研究和技术服务业	6,366,026.23	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	5,310,772.80	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	264,704.86	0.04
R	文化、体育和娱乐业	5,392,551.00	0.85
S	综合	1,901,945.00	0.30
	合计	586,193,735.59	92.86

### 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	002422	科伦药业	261,700	7,767,256.00	1.23
2	002223	鱼跃医疗	191,200	6,881,288.00	1.09
3	600161	天坛生物	248,580	6,748,947.00	1.07
4	000783	长江证券	1,131,000	6,559,800.00	1.04
5	600642	申能股份	893,800	6,247,662.00	0.99
6	002056	横店东磁	323,100	5,883,651.00	0.93
7	600582	天地科技	1,001,300	5,837,579.00	0.92
8	600863	内蒙华电	1,404,077	5,826,919.55	0.92
9	002065	东华软件	824,700	5,822,382.00	0.92
10	002249	大洋电机	1,015,738	5,789,706.60	0.92
11	600985	淮北矿业	500,600	5,766,912.00	0.91
12	002745	木林森	604,700	5,563,240.00	0.88
13	600909	华安证券	1,188,500	5,550,295.00	0.88
14	000630	铜陵有色	1,889,400	5,460,366.00	0.87
15	601717	郑煤机	437,100	5,441,895.00	0.86
16	002373	千方科技	398,200	5,431,448.00	0.86
17	603688	石英股份	46,700	5,316,328.00	0.84
18	600096	云天化	306,900	5,238,783.00	0.83
19	000997	新大陆	277,000	5,235,300.00	0.83
20	600901	江苏金租	1,245,717	5,144,811.21	0.82
21	600637	东方明珠	652,800	5,104,896.00	0.81
22	600258	首旅酒店	268,100	5,080,495.00	0.80
23	600109	国金证券	583,700	5,060,679.00	0.80
24	002600	领益智造	724,300	5,004,913.00	0.79
25	000591	太阳能	717,500	4,864,650.00	0.77
26	600489	中金黄金	470,600	4,861,298.00	0.77
27	600481	双良节能	346,700	4,846,866.00	0.77
28	000739	普洛药业	266,100	4,720,614.00	0.75
29	600998	九州通	447,149	4,641,406.62	0.74
30	600497	驰宏锌锗	906,960	4,552,939.20	0.72
31	002518	科士达	113,100	4,525,131.00	0.72
32	601958	金钼股份	403,900	4,503,485.00	0.71

33	601000	唐山港	1,262,400	4,456,272.00	0.71
34	002384	东山精密	169,100	4,379,690.00	0.69
35	688002	睿创微纳	95,612	4,283,417.60	0.68
36	002739	万达电影	337,700	4,234,758.00	0.67
37	002402	和而泰	240,900	4,090,482.00	0.65
38	603639	海利尔	228,100	4,087,552.00	0.65
39	600038	中直股份	101,600	4,045,712.00	0.64
40	002131	利欧股份	1,756,300	4,039,490.00	0.64
41	601618	中国中冶	1,017,500	4,039,475.00	0.64
42	000338	潍柴动力	322,100	4,013,366.00	0.64
43	600919	江苏银行	544,100	3,999,135.00	0.63
44	601377	兴业证券	648,000	3,965,760.00	0.63
45	000513	丽珠集团	101,500	3,949,365.00	0.63
46	002033	丽江股份	348,290	3,789,395.20	0.60
47	002074	国轩高科	136,905	3,781,316.10	0.60
48	600064	南京高科	567,700	3,752,497.00	0.59
49	600089	特变电工	167,000	3,722,430.00	0.59
50	002017	东信和平	280,430	3,676,437.30	0.58
51	000928	中钢国际	377,900	3,646,735.00	0.58
52	600256	广汇能源	527,700	3,620,022.00	0.57
53	000012	南玻 A	593,900	3,539,644.00	0.56
54	600580	卧龙电驱	239,900	3,504,939.00	0.56
55	002027	分众传媒	496,200	3,379,122.00	0.54
56	300308	中际旭创	22,600	3,332,370.00	0.53
57	000906	浙商中拓	370,600	3,305,752.00	0.52
58	688200	华峰测控	21,116	3,230,748.00	0.51
59	601555	东吴证券	446,024	3,095,406.56	0.49
60	300003	乐普医疗	134,700	3,045,567.00	0.48
61	600438	通威股份	88,400	3,033,004.00	0.48
62	300777	中简科技	63,000	2,977,380.00	0.47
63	600879	航天电子	345,900	2,936,691.00	0.47
64	603027	千禾味业	138,880	2,933,145.60	0.46
65	688018	乐鑫科技	21,881	2,840,591.42	0.45
66	601163	三角轮胎	175,700	2,788,359.00	0.44
67	603156	养元饮品	112,800	2,786,160.00	0.44
68	002570	贝因美	639,200	2,722,992.00	0.43
69	000733	振华科技	28,000	2,683,800.00	0.43
70	300511	雪榕生物	351,600	2,672,160.00	0.42
71	603290	斯达半导	12,200	2,625,440.00	0.42
72	300537	广信材料	158,100	2,583,354.00	0.41
73	603878	武进不锈	305,398	2,580,613.10	0.41
74	688256	寒武纪	13,700	2,575,600.00	0.41
75	603225	新凤鸣	233,000	2,574,650.00	0.41

76	000100	TCL 科技	652,800	2,572,032.00	0.41
77	601128	常熟银行	370,141	2,524,361.62	0.40
78	002852	道道全	191,200	2,472,216.00	0.39
79	601168	西部矿业	235,100	2,470,901.00	0.39
80	301219	腾远钴业	64,700	2,417,192.00	0.38
81	000425	徐工机械	350,700	2,374,239.00	0.38
82	300715	凯伦股份	163,060	2,312,190.80	0.37
83	688287	观典防务	158,125	2,294,393.75	0.36
84	002439	启明星辰	76,600	2,279,616.00	0.36
85	601311	骆驼股份	243,100	2,255,968.00	0.36
86	300121	阳谷华泰	235,230	2,246,446.50	0.36
87	002966	苏州银行	341,260	2,235,253.00	0.35
88	002273	水晶光电	184,679	2,205,067.26	0.35
89	002270	华明装备	200,400	2,194,380.00	0.35
90	600060	海信视像	87,900	2,175,525.00	0.34
91	603160	汇顶科技	46,600	2,155,250.00	0.34
92	600570	恒生电子	47,384	2,098,637.36	0.33
93	000048	京基智农	106,300	2,074,976.00	0.33
94	000589	贵州轮胎	365,600	2,047,360.00	0.32
95	600566	济川药业	68,700	1,995,048.00	0.32
96	600487	亨通光电	135,200	1,982,032.00	0.31
97	600498	烽火通信	87,600	1,784,412.00	0.28
98	002768	国恩股份	73,273	1,772,473.87	0.28
99	300127	银河磁体	94,300	1,709,659.00	0.27
100	600750	江中药业	77,600	1,701,768.00	0.27
101	600508	上海能源	115,100	1,689,668.00	0.27
102	600211	西藏药业	27,500	1,633,500.00	0.26
103	002737	葵花药业	67,100	1,633,214.00	0.26
104	601021	春秋航空	28,300	1,626,401.00	0.26
105	000623	吉林敖东	99,000	1,587,960.00	0.25
106	002465	海格通信	144,500	1,494,130.00	0.24
107	600066	宇通客车	101,100	1,490,214.00	0.24
108	300009	安科生物	148,500	1,485,000.00	0.24
109	300136	信维通信	73,700	1,479,896.00	0.23
110	002507	涪陵榨菜	79,420	1,454,180.20	0.23
111	601077	渝农商行	402,800	1,446,052.00	0.23
112	689009	九号公司	37,543	1,383,459.55	0.22
113	300604	长川科技	29,000	1,377,210.00	0.22
114	002625	光启技术	89,900	1,371,874.00	0.22
115	688009	中国通号	235,976	1,368,660.80	0.22
116	002429	兆驰股份	248,500	1,366,750.00	0.22
117	002025	航天电器	21,000	1,339,800.00	0.21
118	600970	中材国际	105,000	1,338,750.00	0.21

119	002060	粤水电	202,600	1,333,108.00	0.21
120	000157	中联重科	196,800	1,328,400.00	0.21
121	600528	中铁工业	134,100	1,324,908.00	0.21
122	688386	泛亚微透	31,463	1,321,446.00	0.21
123	601997	贵阳银行	255,200	1,316,832.00	0.21
124	600271	航天信息	95,100	1,301,919.00	0.21
125	600141	兴发集团	58,500	1,299,870.00	0.21
126	002926	华西证券	155,400	1,291,374.00	0.20
127	600820	隧道股份	214,100	1,286,741.00	0.20
128	688116	天奈科技	28,100	1,285,575.00	0.20
129	600390	五矿资本	238,500	1,283,130.00	0.20
130	601108	财通证券	176,140	1,275,253.60	0.20
131	600378	昊华科技	33,700	1,268,468.00	0.20
132	603127	昭衍新药	30,900	1,263,810.00	0.20
133	688099	晶晨股份	14,957	1,261,174.24	0.20
134	600673	东阳光	174,500	1,258,145.00	0.20
135	688777	中控技术	20,010	1,256,227.80	0.20
136	688536	思瑞浦	5,700	1,242,600.00	0.20
137	600967	内蒙一机	123,000	1,242,300.00	0.20
138	000050	深天马A	134,900	1,238,382.00	0.20
139	688560	明冠新材	44,532	1,237,544.28	0.20
140	688390	固德威	7,400	1,234,764.00	0.20
141	600517	国网英大	213,000	1,214,100.00	0.19
142	002152	广电运通	102,000	1,195,440.00	0.19
143	603893	瑞芯微	16,400	1,194,740.00	0.19
144	688385	复旦微电	23,800	1,192,380.00	0.19
145	601598	中国外运	253,900	1,183,174.00	0.19
146	603267	鸿远电子	18,100	1,181,930.00	0.19
147	603228	景旺电子	45,800	1,174,770.00	0.19
148	000598	兴蓉环境	216,200	1,173,966.00	0.19
149	600535	天士力	80,800	1,172,408.00	0.19
150	603529	爱玛科技	36,300	1,169,586.00	0.19
151	600707	彩虹股份	244,200	1,162,392.00	0.18
152	688589	力合微	28,265	1,151,516.10	0.18
153	000559	万向钱潮	211,200	1,151,040.00	0.18
154	600718	东软集团	107,800	1,149,148.00	0.18
155	601611	中国核建	134,500	1,136,525.00	0.18
156	002478	常宝股份	151,500	1,128,675.00	0.18
157	002925	盈趣科技	57,900	1,123,260.00	0.18
158	600011	华能国际	120,900	1,119,534.00	0.18
159	002138	顺络电子	46,800	1,118,988.00	0.18
160	002155	湖南黄金	91,400	1,115,080.00	0.18
161	600285	羚锐制药	69,300	1,112,958.00	0.18

162	600667	太极实业	151,000	1,096,260.00	0.17
163	600875	东方电气	58,100	1,083,565.00	0.17
164	601577	长沙银行	139,600	1,083,296.00	0.17
165	300850	新强联	28,900	1,080,282.00	0.17
166	603866	桃李面包	106,200	1,074,744.00	0.17
167	601139	深圳燃气	146,600	1,068,714.00	0.17
168	601298	青岛港	152,600	1,063,622.00	0.17
169	000156	华数传媒	122,200	1,063,140.00	0.17
170	300257	开山股份	70,000	1,061,900.00	0.17
171	600195	中牧股份	90,900	1,061,712.00	0.17
172	601869	长飞光纤	28,600	1,058,486.00	0.17
173	688107	安路科技	18,900	1,046,871.00	0.17
174	603379	三美股份	44,400	1,043,844.00	0.17
175	600968	海油发展	339,200	1,041,344.00	0.16
176	001203	大中矿业	93,600	1,039,896.00	0.16
177	000869	张裕 A	33,800	1,036,308.00	0.16
178	603355	莱克电气	40,400	1,026,564.00	0.16
179	600197	伊力特	37,700	1,024,309.00	0.16
180	601158	重庆水务	182,600	1,015,256.00	0.16
181	600556	天下秀	142,700	1,011,743.00	0.16
182	688185	康希诺	12,400	1,010,600.00	0.16
183	002430	杭氧股份	29,400	1,010,184.00	0.16
184	002423	中粮资本	126,000	1,008,000.00	0.16
185	002110	三钢闽光	238,800	1,007,736.00	0.16
186	002399	海普瑞	87,300	1,001,331.00	0.16
187	688508	芯朋微	17,151	994,586.49	0.16
188	601233	桐昆股份	74,400	985,800.00	0.16
189	600273	嘉化能源	104,500	984,390.00	0.16
190	000027	深圳能源	148,800	980,592.00	0.16
191	688072	拓荆科技	2,300	979,731.00	0.16
192	600597	光明乳业	94,100	978,640.00	0.16
193	600536	中国软件	20,700	970,416.00	0.15
194	600511	国药股份	24,700	959,595.00	0.15
195	601607	上海医药	42,800	959,148.00	0.15
196	000759	中百集团	208,900	942,139.00	0.15
197	601965	中国汽研	45,300	935,445.00	0.15
198	300383	光环新网	86,974	934,970.50	0.15
199	002139	拓邦股份	71,500	933,075.00	0.15
200	600177	雅戈尔	147,000	927,570.00	0.15
201	300763	锦浪科技	8,900	926,490.00	0.15
202	000818	航锦科技	27,700	924,349.00	0.15
203	300661	圣邦股份	11,070	909,179.10	0.14
204	688707	振华新材	29,000	892,910.00	0.14

205	603613	国联股份	24,115	890,566.95	0.14
206	688677	海泰新光	15,400	873,796.00	0.14
207	002885	京泉华	39,700	867,048.00	0.14
208	000688	国城矿业	57,000	864,690.00	0.14
209	600050	中国联通	179,000	859,200.00	0.14
210	300253	卫宁健康	79,100	855,862.00	0.14
211	688123	聚辰股份	15,761	846,680.92	0.13
212	002299	圣农发展	44,100	844,515.00	0.13
213	301096	百诚医药	13,700	830,357.00	0.13
214	002588	史丹利	136,500	829,920.00	0.13
215	300682	朗新科技	35,600	828,768.00	0.13
216	002985	北摩高科	18,700	825,044.00	0.13
217	603826	坤彩科技	16,500	825,000.00	0.13
218	600959	江苏有线	242,200	818,636.00	0.13
219	002916	深南电路	10,800	813,996.00	0.13
220	601615	明阳智能	47,900	808,552.00	0.13
221	002294	信立泰	25,900	807,821.00	0.13
222	002444	巨星科技	36,800	805,184.00	0.13
223	601636	旗滨集团	93,400	805,108.00	0.13
224	002237	恒邦股份	73,400	799,326.00	0.13
225	000932	华菱钢铁	165,600	789,912.00	0.13
226	601231	环旭电子	52,500	785,400.00	0.12
227	300871	回盛生物	47,350	780,328.00	0.12
228	002153	石基信息	55,080	771,120.00	0.12
229	002653	海思科	32,300	762,280.00	0.12
230	688425	铁建重工	157,549	757,810.69	0.12
231	000967	盈峰环境	147,700	745,885.00	0.12
232	000878	云南铜业	67,200	742,560.00	0.12
233	002129	TCL 中环	22,225	737,870.00	0.12
234	000603	盛达资源	60,300	729,027.00	0.12
235	002212	天融信	75,000	727,500.00	0.12
236	002594	比亚迪	2,800	723,156.00	0.11
237	300869	康泰医学	31,300	718,648.00	0.11
238	603757	大元泵业	23,900	713,176.00	0.11
239	000778	新兴铸管	173,000	705,840.00	0.11
240	300450	先导智能	19,100	690,847.00	0.11
241	000528	柳工	86,400	682,560.00	0.11
242	603589	口子窖	13,800	681,030.00	0.11
243	002396	星网锐捷	29,900	675,441.00	0.11
244	603595	东尼电子	15,700	672,274.00	0.11
245	688680	海优新材	5,500	670,010.00	0.11
246	001696	宗申动力	93,400	661,272.00	0.10
247	600478	科力远	91,800	655,452.00	0.10

248	688380	中微半导	22,000	653,180.00	0.10
249	002028	思源电气	13,900	649,408.00	0.10
250	600603	广汇物流	92,500	643,800.00	0.10
251	688080	映翰通	13,160	643,524.00	0.10
252	603026	胜华新材	10,800	639,900.00	0.10
253	300382	斯莱克	47,500	626,525.00	0.10
254	300691	联合光电	35,300	621,986.00	0.10
255	002266	浙富控股	150,300	620,739.00	0.10
256	002078	太阳纸业	58,000	620,020.00	0.10
257	002150	通润装备	36,200	615,038.00	0.10
258	000636	风华高科	39,900	612,066.00	0.10
259	300532	今天国际	29,700	610,632.00	0.10
260	688105	诺唯赞	19,900	606,751.00	0.10
261	002203	海亮股份	49,700	596,897.00	0.09
262	600329	达仁堂	13,200	592,548.00	0.09
263	000728	国元证券	90,700	591,364.00	0.09
264	603517	绝味食品	15,800	586,970.00	0.09
265	688082	盛美上海	5,300	585,120.00	0.09
266	601969	海南矿业	88,700	583,646.00	0.09
267	300776	帝尔激光	8,800	571,120.00	0.09
268	600152	维科技术	60,400	560,512.00	0.09
269	600138	中青旅	44,200	552,942.00	0.09
270	002128	电投能源	41,700	551,274.00	0.09
271	000750	国海证券	163,700	548,395.00	0.09
272	002683	广东宏大	18,600	547,584.00	0.09
273	601001	晋控煤业	58,300	545,688.00	0.09
274	000951	中国重汽	31,800	535,830.00	0.08
275	300839	博汇股份	40,061	532,410.69	0.08
276	000729	燕京啤酒	41,000	511,270.00	0.08
277	688029	南微医学	6,200	505,672.00	0.08
278	600458	时代新材	41,500	497,585.00	0.08
279	002690	美亚光电	19,300	496,975.00	0.08
280	000060	中金岭南	104,400	495,900.00	0.08
281	002572	索菲亚	28,400	494,728.00	0.08
282	000058	深赛格	79,800	493,164.00	0.08
283	603219	富佳股份	34,600	493,050.00	0.08
284	002250	联化科技	46,600	487,436.00	0.08
285	600126	杭钢股份	106,500	462,210.00	0.07
286	002912	中新赛克	10,500	462,105.00	0.07
287	688188	柏楚电子	2,400	452,544.00	0.07
288	002467	二六三	88,300	438,851.00	0.07
289	603556	海兴电力	17,100	431,604.00	0.07
290	002468	申通快递	39,800	430,636.00	0.07

291	600363	联创光电	11,600	430,360.00	0.07
292	002860	星帅尔	31,900	430,012.00	0.07
293	603345	安井食品	2,900	425,720.00	0.07
294	002283	天润工业	66,000	423,720.00	0.07
295	603868	飞科电器	6,700	422,703.00	0.07
296	603018	华设集团	48,100	420,875.00	0.07
297	002156	通富微电	18,600	420,360.00	0.07
298	002081	金螳螂	87,800	395,978.00	0.06
299	603612	索通发展	22,800	395,124.00	0.06
300	603330	天洋新材	35,300	392,183.00	0.06
301	688186	广大特材	11,900	387,107.00	0.06
302	603609	禾丰股份	42,100	383,110.00	0.06
303	300751	迈为股份	2,200	372,636.00	0.06
304	603515	欧普照明	18,200	369,460.00	0.06
305	002466	天齐锂业	5,200	363,532.00	0.06
306	600533	栖霞建设	116,700	359,436.00	0.06
307	601908	京运通	58,400	353,320.00	0.06
308	002544	普天科技	15,400	352,660.00	0.06
309	601137	博威合金	22,400	348,544.00	0.06
310	000703	恒逸石化	50,500	342,390.00	0.05
311	300134	大富科技	33,400	342,350.00	0.05
312	688008	澜起科技	5,900	338,778.00	0.05
313	600748	上实发展	85,700	338,515.00	0.05
314	601069	西部黄金	26,000	333,840.00	0.05
315	603212	赛伍技术	16,000	332,960.00	0.05
316	688298	东方生物	8,760	330,427.20	0.05
317	688208	道通科技	10,800	327,348.00	0.05
318	600160	巨化股份	23,200	319,696.00	0.05
319	601028	玉龙股份	29,400	316,050.00	0.05
320	601688	华泰证券	22,100	304,317.00	0.05
321	688348	昱能科技	1,600	300,528.00	0.05
322	002829	星网宇达	6,800	298,724.00	0.05
323	002049	紫光国微	3,200	298,400.00	0.05
324	688295	中复神鹰	8,000	293,440.00	0.05
325	300177	中海达	42,600	288,402.00	0.05
326	600446	金证股份	19,400	282,076.00	0.04
327	600085	同仁堂	4,900	282,044.00	0.04
328	300041	回天新材	23,280	274,704.00	0.04
329	301486	致尚科技	4,689	270,367.74	0.04
330	600655	豫园股份	39,400	270,284.00	0.04
331	601198	东兴证券	33,600	269,472.00	0.04
332	601877	正泰电器	9,700	268,205.00	0.04
333	300035	中科电气	22,100	265,642.00	0.04

334	600377	宁沪高速	27,000	265,410.00	0.04
335	002850	科达利	2,000	264,500.00	0.04
336	600895	张江高科	18,100	251,952.00	0.04
337	600663	陆家嘴	25,400	250,698.00	0.04
338	601336	新华保险	6,600	242,682.00	0.04
339	002130	沃尔核材	29,800	241,976.00	0.04
340	000761	本钢板材	60,300	241,200.00	0.04
341	300244	迪安诊断	9,400	240,922.00	0.04
342	688499	利元亨	3,780	240,105.60	0.04
343	605339	南侨食品	11,900	236,929.00	0.04
344	600184	光电股份	18,000	236,340.00	0.04
345	688779	长远锂科	20,800	234,416.00	0.04
346	600502	安徽建工	43,600	230,208.00	0.04
347	600348	华阳股份	29,000	229,390.00	0.04
348	603816	顾家家居	6,000	228,900.00	0.04
349	002092	中泰化学	34,800	224,460.00	0.04
350	000581	威孚高科	14,100	222,075.00	0.04
351	603093	南华期货	20,300	221,067.00	0.04
352	600153	建发股份	20,200	220,382.00	0.03
353	300835	龙磁科技	6,900	216,522.00	0.03
354	600850	电科数字	9,000	212,310.00	0.03
355	603185	弘元绿能	2,800	208,740.00	0.03
356	600552	凯盛科技	17,300	204,832.00	0.03
357	300423	昇辉科技	16,700	204,074.00	0.03
358	002443	金洲管道	30,100	200,466.00	0.03
359	603348	文灿股份	4,500	197,145.00	0.03
360	603579	荣泰健康	9,400	196,648.00	0.03
361	002268	电科网安	7,000	195,090.00	0.03
362	688001	华兴源创	5,300	187,726.00	0.03
363	300613	富瀚微	3,200	181,568.00	0.03
364	600166	福田汽车	53,400	181,560.00	0.03
365	601003	柳钢股份	44,800	180,992.00	0.03
366	688599	天合光能	4,200	178,962.00	0.03
367	688063	派能科技	900	178,425.00	0.03
368	002651	利君股份	22,600	175,602.00	0.03
369	603737	三棵树	2,660	174,017.20	0.03
370	600867	通化东宝	16,500	172,260.00	0.03
371	688786	悦安新材	3,600	167,004.00	0.03
372	688183	生益电子	13,700	165,770.00	0.03
373	688556	高测股份	3,080	163,671.20	0.03
374	600183	生益科技	11,500	163,300.00	0.03
375	600559	老白干酒	6,500	159,315.00	0.03
376	300699	光威复材	5,000	154,250.00	0.02

377	605376	博迁新材	4,900	153,762.00	0.02
378	001872	招商港口	8,900	153,703.00	0.02
379	000534	万泽股份	8,400	140,868.00	0.02
380	300418	昆仑万维	3,400	136,952.00	0.02
381	603068	博通集成	4,200	120,204.00	0.02
382	600773	西藏城投	9,300	117,180.00	0.02
383	003028	振邦智能	2,800	117,068.00	0.02
384	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
385	601222	林洋能源	14,100	115,479.00	0.02
386	002326	永太科技	7,300	111,617.00	0.02
387	002169	智光电气	13,400	111,086.00	0.02
388	688066	航天宏图	1,800	109,620.00	0.02
389	002568	百润股份	3,000	109,050.00	0.02
390	002483	润邦股份	18,800	109,040.00	0.02
391	600728	佳都科技	15,700	108,801.00	0.02
392	600859	王府井	5,400	106,866.00	0.02
393	688439	振华风光	900	98,838.00	0.02
394	300251	光线传媒	11,700	94,653.00	0.01
395	300379	东方通	4,500	92,565.00	0.01
396	301026	浩通科技	2,500	89,300.00	0.01
397	000529	广弘控股	14,000	89,040.00	0.01
398	003019	宸展光电	4,290	87,945.00	0.01
399	601828	美凯龙	18,300	87,657.00	0.01
400	300033	同花顺	500	87,640.00	0.01
401	601998	中信银行	14,600	87,308.00	0.01
402	002242	九阳股份	5,800	86,710.00	0.01
403	002540	亚太科技	14,800	85,544.00	0.01
404	600928	西安银行	23,800	83,776.00	0.01
405	688249	晶合集成	4,381	79,120.86	0.01
406	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
407	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
408	000062	深圳华强	6,500	74,230.00	0.01
409	688138	清溢光电	3,500	73,885.00	0.01
410	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
411	600547	山东黄金	3,100	72,788.00	0.01
412	600057	厦门象屿	7,800	67,860.00	0.01
413	600323	瀚蓝环境	3,500	66,255.00	0.01
414	000988	华工科技	1,600	60,816.00	0.01
415	002154	报喜鸟	10,900	60,168.00	0.01
416	601686	友发集团	8,300	56,772.00	0.01
417	000301	东方盛虹	4,800	56,736.00	0.01
418	002453	华软科技	5,100	54,519.00	0.01
419	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.01

420	002051	中工国际	4,400	52,492.00	0.01
421	600025	华能水电	7,300	52,049.00	0.01
422	002340	格林美	7,400	51,134.00	0.01
423	688037	芯源微	296	50,601.20	0.01
424	688630	芯碁微装	600	50,412.00	0.01
425	688012	中微公司	300	46,935.00	0.01
426	688472	阿特斯	2,734	46,587.36	0.01
427	002421	达实智能	13,200	46,464.00	0.01
428	002019	亿帆医药	3,000	43,800.00	0.01
429	688596	正帆科技	1,000	43,300.00	0.01
430	688469	中芯集成	7,859	42,517.19	0.01
431	300260	新莱应材	1,060	41,891.20	0.01
432	603690	至纯科技	1,200	41,808.00	0.01
433	688361	中科飞测	641	41,453.47	0.01
434	301358	湖南裕能	966	41,431.74	0.01
435	300666	江丰电子	600	40,776.00	0.01
436	688443	智翔金泰	1,361	40,135.89	0.01
437	600641	万业企业	2,100	40,089.00	0.01
438	002158	汉钟精机	1,600	39,936.00	0.01
439	603786	科博达	600	39,420.00	0.01
440	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.01
441	300567	精测电子	400	38,060.00	0.01
442	688120	华海清科	149	37,555.45	0.01
443	603516	淳中科技	1,700	37,485.00	0.01
444	300820	英杰电气	450	37,071.00	0.01
445	688531	日联科技	271	36,847.87	0.01
446	300130	新国都	1,300	36,829.00	0.01
447	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
448	600537	亿晶光电	4,500	34,380.00	0.01
449	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
450	002371	北方华创	100	31,765.00	0.01
451	300349	金卡智能	2,200	30,536.00	0.00
452	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
453	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
454	002549	凯美特气	2,300	26,450.00	0.00
455	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
456	688146	中船特气	688	26,233.44	0.00
457	688352	颀中科技	2,153	25,986.71	0.00
458	000987	越秀资本	4,000	25,400.00	0.00
459	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
460	001287	中电港	1,088	22,869.76	0.00
461	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
462	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00

463	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
464	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
465	601061	中信金属	2,403	18,214.74	0.00
466	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
467	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
468	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
469	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
470	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
471	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
472	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
473	600419	天润乳业	900	14,598.00	0.00
474	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
475	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
476	600546	山煤国际	1,000	14,470.00	0.00
477	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
478	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
479	600372	中航电子	900	13,662.00	0.00
480	600037	歌华有线	1,600	13,296.00	0.00
481	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
482	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
483	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
484	603822	嘉澳环保	400	13,020.00	0.00
485	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
486	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
487	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
488	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
489	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
490	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
491	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
492	688981	中芯国际	200	10,104.00	0.00
493	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
494	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
495	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
496	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
497	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
498	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
499	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
500	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
501	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
502	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
503	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
504	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
505	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00

506	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
507	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
508	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
509	000883	湖北能源	1,100	5,016.00	0.00
510	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
511	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
512	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
513	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
514	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
515	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
516	600185	格力地产	200	1,372.00	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	600535	天士力	27,757,372.97	3.73
2	601000	唐山港	27,683,454.10	3.72
3	600985	淮北矿业	26,456,403.76	3.56
4	600258	首旅酒店	26,265,153.00	3.53
5	600064	南京高科	25,906,962.00	3.48
6	600298	安琪酵母	24,689,016.84	3.32
7	000513	丽珠集团	23,488,446.00	3.16
8	300017	网宿科技	22,739,155.00	3.06
9	600863	内蒙华电	22,631,535.13	3.04
10	600566	济川药业	21,267,453.86	2.86
11	603688	石英股份	21,265,814.70	2.86
12	600089	特变电工	21,142,264.96	2.84
13	601958	金钼股份	20,714,231.00	2.78
14	603290	斯达半导	19,628,694.00	2.64
15	601168	西部矿业	19,259,066.00	2.59
16	601717	郑煤机	19,257,508.00	2.59
17	002249	大洋电机	19,141,766.98	2.57
18	002506	协鑫集成	19,073,171.00	2.56
19	600919	江苏银行	19,025,666.00	2.56
20	002056	横店东磁	18,935,939.00	2.54
21	002353	杰瑞股份	18,196,955.12	2.45
22	600563	法拉电子	17,514,261.00	2.35
23	600808	马钢股份	17,282,916.00	2.32
24	600352	浙江龙盛	16,899,211.40	2.27
25	000563	陕国投 A	16,636,523.00	2.24
26	300121	阳谷华泰	16,409,779.40	2.21
27	600066	宇通客车	16,369,174.00	2.20
28	600968	海油发展	16,270,088.00	2.19

29	600741	华域汽车	16,205,534.00	2.18
30	600153	建发股份	16,180,202.70	2.17
31	600598	北大荒	16,131,578.00	2.17
32	002049	紫光国微	15,982,351.00	2.15
33	300009	安科生物	15,872,118.00	2.13
34	600901	江苏金租	15,612,631.74	2.10
35	600376	首开股份	15,424,465.00	2.07
36	000591	太阳能	15,306,697.00	2.06
37	600820	隧道股份	15,294,058.48	2.06
38	000060	中金岭南	14,984,099.00	2.01
39	002027	分众传媒	14,974,333.00	2.01
40	601231	环旭电子	14,973,876.00	2.01

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600064	南京高科	30,683,635.00	4.12
2	600535	天士力	29,118,922.00	3.91
3	002273	水晶光电	27,889,191.70	3.75
4	600298	安琪酵母	27,705,164.74	3.72
5	600563	法拉电子	27,023,759.78	3.63
6	603688	石英股份	25,248,217.40	3.39
7	300017	网宿科技	24,902,926.00	3.35
8	601231	环旭电子	24,283,177.00	3.26
9	000513	丽珠集团	24,070,298.00	3.23
10	601000	唐山港	23,099,103.40	3.10
11	600863	内蒙华电	22,942,827.00	3.08
12	600901	江苏金租	22,895,863.12	3.08
13	002738	中矿资源	22,725,431.80	3.05
14	300009	安科生物	22,708,201.00	3.05
15	600598	北大荒	22,594,073.00	3.04
16	002192	融捷股份	22,152,343.00	2.98
17	603026	胜华新材	21,901,063.43	2.94
18	002049	紫光国微	21,160,539.80	2.84
19	601108	财通证券	20,823,365.10	2.80
20	600153	建发股份	19,681,114.02	2.64
21	002506	协鑫集成	19,310,160.00	2.59
22	601991	大唐发电	19,287,684.00	2.59
23	600089	特变电工	19,136,967.51	2.57
24	600566	济川药业	19,069,887.10	2.56
25	002353	杰瑞股份	18,982,876.12	2.55
26	603259	药明康德	18,980,003.15	2.55
27	601555	东吴证券	18,975,295.00	2.55

28	600985	淮北矿业	18,967,159.20	2.55
29	600258	首旅酒店	18,813,496.94	2.53
30	601128	常熟银行	18,775,405.00	2.52
31	600998	九州通	18,677,550.98	2.51
32	601958	金钼股份	18,041,490.88	2.42
33	601168	西部矿业	17,885,747.00	2.40
34	300861	美畅股份	17,597,828.76	2.36
35	002391	长青股份	17,381,601.76	2.34
36	600170	上海建工	16,843,768.00	2.26
37	600808	马钢股份	16,840,300.00	2.26
38	603886	元祖股份	16,707,396.01	2.25
39	600066	宇通客车	16,585,054.00	2.23
40	600820	隧道股份	16,550,579.84	2.22
41	000563	陕国投 A	16,489,276.00	2.22
42	600567	山鹰国际	16,167,620.20	2.17
43	605369	拱东医疗	16,105,671.00	2.16
44	600376	首开股份	15,928,689.00	2.14
45	000738	航发控制	15,895,419.00	2.14
46	002074	国轩高科	15,856,600.00	2.13
47	603868	飞科电器	15,838,230.00	2.13
48	688289	圣湘生物	15,799,383.14	2.12
49	600352	浙江龙盛	15,699,598.40	2.11
50	600741	华域汽车	15,675,654.00	2.11
51	002807	江阴银行	15,627,581.00	2.10
52	601717	郑煤机	15,544,860.00	2.09
53	600728	佳都科技	15,477,046.00	2.08
54	600968	海油发展	15,406,168.00	2.07
55	000012	南玻 A	15,325,934.00	2.06
56	603290	斯达半导	15,020,088.00	2.02

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	2,923,313,009.77
卖出股票收入（成交）总额	3,044,426,226.01

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）	607,043.75	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	607,043.75	0.10

## 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	5,000	500,041.64	0.08
2	118036	力合转债	1,070	107,002.11	0.02

## 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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率和交易成本。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

江苏鱼跃医疗设备股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到镇江市市场监督管理局的处罚。

东华软件股份公司在报告编制日前一年内曾受到新余市财政局的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	193,372.24
2	应收清算款	310,651.93
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	82,086.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	586,110.41

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
132,186	2,950.07	70,867,332.62	18.17	319,090,172.61	81.83

**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	98,063.88	0.025147

**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。

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2015年2月4日）基金份额总额	1,407,874,200.24
本报告期期初基金份额总额	456,489,143.72
本报告期基金总申购份额	23,570,587.54
减：本报告期基金总赎回份额	90,102,226.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	389,957,505.23

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比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
天风证券股份有限公司	1	828,831,027.51	13.92	771,879.53	13.92	-
华金证券股份有限公司	2	724,282,764.99	12.16	674,522.52	12.16	-
招商证券股份有限公司	1	538,136,747.97	9.04	501,180.06	9.04	-
华创证券有限责任公司	1	526,243,885.90	8.84	490,083.67	8.84	-
光大证券股份有限公司	2	449,221,072.78	7.54	418,367.71	7.54	-
中信证券股份有限公司	4	423,989,871.59	7.12	394,863.32	7.12	-
广发证券股份有限公司	1	375,115,906.81	6.30	349,336.69	6.30	-
东方证券股份有限公司	1	374,785,105.92	6.29	349,036.31	6.29	-
东北证券股份有限公司	1	368,299,097.90	6.18	342,989.78	6.18	-
中泰证券股份有限公司	2	367,046,968.83	6.16	341,831.72	6.16	-
西部证券股份有限公司	2	294,002,487.70	4.94	273,804.71	4.94	-
渤海证券股份有限公司	1	249,305,170.47	4.19	232,180.59	4.19	-
中信建投证券股份有限公司	2	165,343,048.65	2.78	153,986.50	2.78	-
国信证券股份有限公司	2	121,534,390.54	2.04	113,183.00	2.04	-
长江证券股份	1	87,813,667.65	1.47	81,782.25	1.47	-

有限公司						
安信证券股份有限公司	1	36,989,308.13	0.62	34,448.09	0.62	-
东方财富证券股份有限公司	2	23,803,163.88	0.40	22,169.54	0.40	-
长城证券股份有限公司	2	624,568.46	0.01	581.65	0.01	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

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	
	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

		(%)		(%)		(%)
天风证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	1,503,748.57	86.87	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	227,224.65	13.13	-	-	-	-
西部证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-

中国国际金融 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 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	景顺长城量化精选股票型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
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	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 10 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 24 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 25 日
6	景顺长城量化精选股票型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 8 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 18 日
10	景顺长城量化精选股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 22 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 6 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 13 日
15	景顺长城量化精选股票型证券投资基金 2023 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 26 日
16	景顺长城量化精选股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 26 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 27 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 10 日
19	关于旗下部分基金新增杭州银行股份	中国证监会指定报刊及	2023 年 6 月 16 日

	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	网站	
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	2023 年 6 月 17 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 22 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城量化精选股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城量化精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城量化精选股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城量化精选股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日