

长江红利回报混合型发起式证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:长江证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月30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06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	8
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遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46
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	46
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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	49
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	49
§9	开放式基金份额变动	49
§10	重大事件揭示	50
10.1	基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4	基金投资策略的改变	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8	其他重大事件	52
§11	备查文件目录	54
11.1	备查文件目录	54
11.2	存放地点	54
11.3	查阅方式	54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长江红利回报混合型发起式证券投资基金	
基金简称	长江红利回报混合型发起式	
基金主代码	013934	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年11月10日	
基金管理人	长江证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	232,930,353.87份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长江红利回报混合型发起式A	长江红利回报混合型发起式C
下属分级基金的交易代码	013934	013935
报告期末下属分级基金的份额总额	210,068,123.21份	22,862,230.66份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选具有持续分红能力且估值相对合理的优质上市公司，并结合积极的大类资产配置，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的主要投资策略包括： 1、资产配置策略 2、红利回报主题的界定 3、股票投资策略 4、债券投资策略 5、衍生品投资策略 （1）股指期货投资策略 （2）国债期货投资策略 6、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中证红利指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高

	于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
--	------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长江证券（上海）资产管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高杨	陆志俊
	联系电话	4001-166-866	95559
	电子邮箱	zgxxpl@cjsc.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4001-166-866	95559
传真		021-80301393	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号世纪汇一座27层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200122	200336
法定代表人		高占军	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cjzcgf.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长江证券（上海）资产管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27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01月01日-2023年06月30日)	
	长江红利回报混合型发起式A	长江红利回报混合型发起式C
本期已实现收益	-5,070,795.46	-534,674.08
本期利润	3,215,932.11	126,841.90
加权平均基金份额本期利润	0.0137	0.0052
本期加权平均净值利润率	1.44%	0.55%
本期基金份额净值增长率	0.55%	0.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	-13,730,359.10	-1,633,732.04
期末可供分配基金份额利润	-0.0654	-0.0715
期末基金资产净值	196,337,764.11	21,228,498.62
期末基金份额净值	0.9346	0.9285
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-6.54%	-7.15%

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；表中的“期末”均指报告期最后一日，即6月30日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。（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，计入费用后投资人的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

长江红利回报混合型发起式A

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	①-③	②-④

				④		
过去一个月	-0.09%	0.83%	-1.90%	0.58%	1.81%	0.25%
过去三个月	0.69%	0.96%	-0.98%	0.63%	1.67%	0.33%
过去六个月	0.55%	0.90%	3.04%	0.57%	-2.49%	0.33%
过去一年	-5.31%	0.97%	0.82%	0.69%	-6.13%	0.28%
自基金合同生效起至今	-6.54%	0.90%	4.43%	0.83%	-10.97%	0.07%

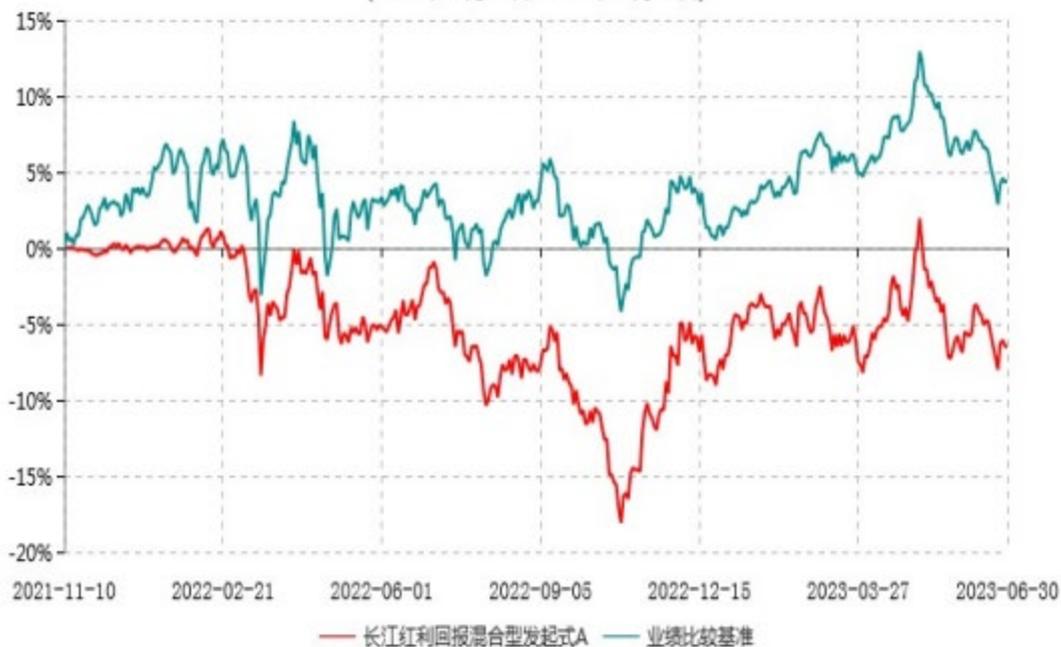
长江红利回报混合型发起式C

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	-0.12%	0.83%	-1.90%	0.58%	1.78%	0.25%
过去三个月	0.60%	0.96%	-0.98%	0.63%	1.58%	0.33%
过去六个月	0.35%	0.90%	3.04%	0.57%	-2.69%	0.33%
过去一年	-5.69%	0.97%	0.82%	0.69%	-6.51%	0.28%
自基金合同生效起至今	-7.15%	0.90%	4.43%	0.83%	-11.58%	0.07%

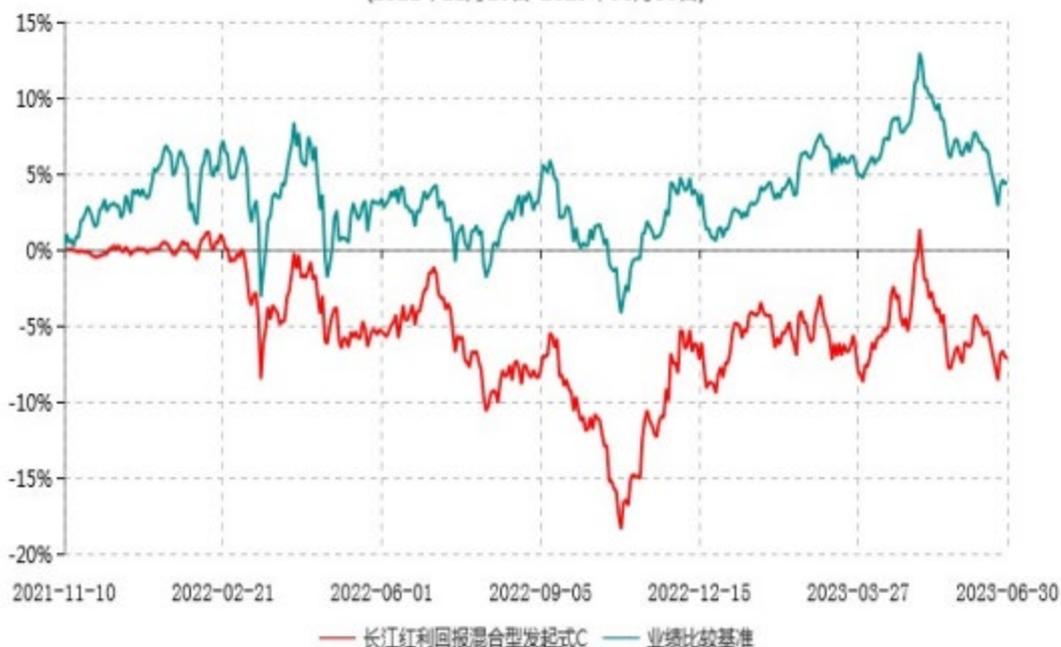
注：本基金基金合同生效日为2021年11月10日，业绩比较基准为中证红利指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长江红利回报混合型发起式A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年11月10日-2023年06月30日)



长江红利回报混合型发起式C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年11月10日-2023年06月30日)



§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

长江证券（上海）资产管理有限公司于2014年9月16日正式成立，是长江证券股份有限公司旗下专门从事证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务的全资子公司。注册地上海，注册资本23亿元人民币。

公司秉承"专业至臻，追求卓越"的理念，致力于为广大投资者创造稳定而丰厚的回报。公司以"客户导向、研究驱动、技术领先、内控先行"为业务发展策略，全方位参与客户资产配置和资产增值全过程，通过深度挖掘客户的投融资需求，紧跟市场创新步伐，以满足客户差异化需求。在严格控制风险的前提下，挑选优质投资品种，丰富创新产品架构，为客户提供多元化资产配置方案。

截至本报告期末，本基金管理人管理的基金有长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐享货币市场基金、长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐越定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、长江安盈中短债六个月定期开放债券型证券投资基金、长江添利混合型证券投资基金、长江安享纯债18个月定期开放债券型证券投资基金、长江均衡成长混合型发起式证券投资基金、长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金、长江新能源产业混合型发起式证券投资基金、长江沪深300指数增强型发起式证券投资基金、长江量化科技精选一个月滚动持有股票型发起式证券投资基金、长江双盈6个月持有期债券型发起式证券投资基金、长江红利回报混合型发起式证券投资基金、长江致惠30天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、长江鑫选3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长江智能制造混合型发起式证券投资基金、长江新兴产业混合型发起式证券投资基金、长江丰瑞3个月持有期债券型证券投资基金、长江启航混合型发起式证券投资基金、长江尊利债券型证券投资基金、长江智选3个月持有期混合型基金中基金（FOF）、长江聚利债券型证券投资基金、长江货币管家货币市场基金、长江时代精选混合型发起式证券投资基金、长江惠盈9个月持有期债券型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐婕	基金经理	2021-11-10	-	22年	国籍：中国。博士研究生，具备基金从业资格。曾任群益国际控股有限公司研究员，汇添富基金管理有限公司基金经理、投资经

					理，上海明河投资管理股份有限公司研究总监，上海启石资产股份有限公司研究总监，富安达基金管理有限公司策略研究员。现任长江证券（上海）资产管理有限公司公募权益投资部总经理，长江添利混合型证券投资基金、长江均衡成长混合型发起式证券投资基金、长江红利回报混合型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：（1）此处的任职日期、离职日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；（2）证券从业的含义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场 and 不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

（一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在1%数量级及以下，且大部分溢价率均值通过95%置信度下等于0的t检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取T=3和T=5作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数=30），溢价率均值大部分在1%数量级及以下。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的t检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金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

三年疫情终于结束，万物复苏，投资者们开始以积极的心态拥抱A股。今年证券市场以多热点轮动的春季躁动开场，给予了投资者极大的希望。上半年证券市场投资热点多次转换，涌现了多个投资主题，包括疫情修复和经济复苏、中国特色估值体系、信创和人工智能等。科技主题是今年以来证券市场的最大亮点，GhatGPT横空出世，国内各大机构纷纷跟上，各种AI模型层出不穷。基于算力、传输、算法、素材等的投资主题风起云涌，共同构成了AI大潮。前几年沉寂的TMT板块成为今年以来最亮的明星。在市场合力的作用下，证券市场非常活跃，也给投资者带来了层出不穷的投资机会。

本基金今年上半年基于对经济复苏的良好期望，一直保持着较高的权益仓位。同时在绩优资产中多点布局，重点投资于顺周期的经济复苏行业和估值具有绝对优势的中特估个股。截至6月30日，本基金投资策略经过市场验证，取得一定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金A类基金份额净值为0.9346元，C类基金份额净值为0.9285元。本报告期内，A类基金份额净值增长率为0.55%，同期业绩比较基准收益率为3.04%；C类基金份额净值增长率为0.35%，同期业绩比较基准收益率为3.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，本基金对中国经济周期将再次进入复苏阶段抱有更加强烈的信心。因此在投资上将更多地配置能够分享经济增长的顺周期行业，时刻观察消费行业基本面的变化，伺机增加配置。本基金将不断的挖掘新的投资机会，不断进步，以期增加基金的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会由公司领导、运营部、财务部、权益研究部、固定收益研究部、法律合规部、风险管理部等相关部门工作人员组成。估值委员会成员具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，基金合同生效日为2021年11月10日，截至本报告期末生效未满足三年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§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

基金托管人在长江红利回报混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

长江证券（上海）资产管理有限公司在长江红利回报混合型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

由长江证券（上海）资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关长江红利回报混合型发起式证券投资基金的2023年中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长江红利回报混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,713,336.99	19,595,356.14
结算备付金		512,932.30	996,155.39
存出保证金		29,259.13	22,510.16
交易性金融资产	6.4.7.2	189,917,238.61	241,735,583.90
其中：股票投资		173,895,177.51	241,735,583.90
基金投资		-	-
债券投资		16,022,061.10	-
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	-4,398.63	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		13,006,597.95	-
应收股利		-	-
应收申购款		54,558.65	263.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		218,229,525.00	262,349,869.47
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
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		82,104.86	68,847.14
应付管理人报酬		273,333.17	336,472.17
应付托管费		36,444.39	44,862.94
应付销售服务费		7,187.64	8,165.55
应付投资顾问费		-	-
应交税费		342.85	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.6	263,849.36	231,317.52
负债合计		663,262.27	689,665.32
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	232,930,353.87	281,619,047.51
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-15,364,091.14	-19,958,843.36
净资产合计		217,566,262.73	261,660,204.15
负债和净资产总计		218,229,525.00	262,349,869.47

注：报告截止日2023年6月30日，本基金份额总额232,930,353.87份。其中A类基金份额净值0.9346元，基金份额总额210,068,123.21份；C类基金份额净值0.9285元，基金份额总额22,862,230.66份。

6.2 利润表

会计主体：长江红利回报混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日 至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日 至2022年06月30日
一、营业总收入		5,575,752.73	-1,679,793.31
1.利息收入		87,245.63	1,271,942.05
其中：存款利息收入	6.4.7.9	62,677.58	409,922.76
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		24,568.05	862,019.29
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,486,253.33	4,293,328.96
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-6,520,833.18	730,275.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	162,950.05	-
资产支持证券投资收益		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	2,871,629.80	3,563,053.00
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)	6.4.7.14	8,948,243.55	-7,656,481.90
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.15	26,516.88	411,417.58
减：二、营业总支出		2,232,978.72	3,388,221.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,843,338.59	2,823,438.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	245,778.48	376,458.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	45,960.05	86,359.78
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		442.33	-
其中：卖出回购金融资产支出		442.33	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		36.73	-
8. 其他费用	6.4.7.17	97,422.54	101,964.75
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		3,342,774.01	-5,068,014.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		3,342,774.01	-5,068,014.64
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,342,774.01	-5,068,014.64

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：长江红利回报混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2023年01月01日至2023年06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）	281,619,047.51	-	-19,958,843.36	261,660,204.15
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）	281,619,047.51	-	-19,958,843.36	261,660,204.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-48,688,693.64	-	4,594,752.22	-44,093,941.42
（一）、综合收益总额	-	-	3,342,774.01	3,342,774.01
（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）	-48,688,693.64	-	1,251,978.21	-47,436,715.43
其中：1.基金申购款	12,225,837.52	-	-452,995.13	11,772,842.39
2.基金赎回款	-60,914,531.16	-	1,704,973.34	-59,209,557.82
（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）	232,930,353.87	-	-15,364,091.14	217,566,262.73

项 目	上年度可比期间			
	2022年01月01日至2022年06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）	533,603,856.32	-	51,000.69	533,654,857.01
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）	533,603,856.32	-	51,000.69	533,654,857.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-215,812,440.27	-	-4,238,008.26	-220,050,448.53
（一）、综合收益总额	-	-	-5,068,014.64	-5,068,014.64
（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）	-215,812,440.27	-	830,006.38	-214,982,433.89
其中：1.基金申购款	8,762,411.22	-	-322,403.90	8,440,007.32
2.基金赎回款	-224,574,851.49	-	1,152,410.28	-223,422,441.21
（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）	317,791,416.05	-	-4,187,007.57	313,604,408.48

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：

高占军

杨忠

何永生

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

长江红利回报混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]3071号文《关于准予长江红利回报混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由长江证券（上海）资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江红利回报混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，基金存续期限为不定期，首次设立募集资金为533,531,439.55元，认购资金在募集期间产生的利息为72,416.77元，合计为533,603,856.32元，按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，折合基金份额为533,603,856.32份，业经中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）众环验字（2021）0100086号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长江红利回报混合型发起式证券投资基金基金合同》于2021年11月10日正式生效。本基金的基金管理人为长江证券（上海）资产管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江红利回报混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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为60%~95%，其中，投资于符合本基金定义的红利回报主题证券的比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债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、应收申购款等。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

本基金的业绩比较基准为：中证红利指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表按照财政部颁布的各项企业会计准则、应用指南、解释、《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（以下简称“企业会计准则”），以及中国证监会颁布的《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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的其他有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则以及中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的有关规定和允许的基金行业实务操作的要求，真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况、自2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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、会计估计与最近一期年度报告所采用的会计政策、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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个

人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征增值税；公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(3) 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，暂不缴纳企业所得税。

(4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。

(5) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

(6) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

本基金运作过程中涉及的各纳税主体、纳税义务按上述税收法律法规执行。

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06月30日
活期存款	14,713,336.99
等于：本金	14,710,319.98

加：应计利息	3,017.01
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1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	14,713,336.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	192,639,701.48	-	173,895,177.51	-18,744,523.97	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	16,190,976.18	88,561.10	16,022,061.10	-257,476.18
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	16,190,976.18	88,561.10	16,022,061.10	-257,476.18
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	208,830,677.66	88,561.10	189,917,238.61	-19,002,000.15	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-4,398.63	-
银行间市场	-	-
合计	-4,398.63	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06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	51,181.07
其中：交易所市场	51,181.07
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	212,668.29
合计	263,849.36

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 长江红利回报混合型发起式A

金额单位：人民币元

项目 (长江红利回报混合型发起式A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	255,718,858.11	255,718,858.11
本期申购	8,027,533.31	8,027,533.31
本期赎回(以“-”号填列)	-53,678,268.21	-53,678,268.21
本期末	210,068,123.21	210,068,123.21

6.4.7.7.2 长江红利回报混合型发起式C

金额单位：人民币元

项目 (长江红利回报混合型发起式C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	25,900,189.40	25,900,189.40
本期申购	4,198,304.21	4,198,304.21
本期赎回(以“-”号填列)	-7,236,262.95	-7,236,262.95
本期末	22,862,230.66	22,862,230.66

注：上述“申购”含红利再投、转换入份额，“赎回”含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润**6.4.7.8.1 长江红利回报混合型发起式A**

单位：人民币元

项目 (长江红利回报混合型发起式A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,712,503.97	-20,736,369.24	-18,023,865.27
本期利润	-5,070,795.46	8,286,727.57	3,215,932.11
本期基金份额交易产生的变动数	658,144.74	419,429.32	1,077,574.06
其中：基金申购款	-129,755.03	-226,298.64	-356,053.67

基金赎回款	787,899.77	645,727.96	1,433,627.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,700,146.75	-12,030,212.35	-13,730,359.10

6.4.7.8.2 长江红利回报混合型发起式C

单位：人民币元

项目 (长江红利回报混合型发起式C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	162,688.15	-2,097,666.24	-1,934,978.09
本期利润	-534,674.08	661,515.98	126,841.90
本期基金份额交易产生的变动数	46,786.61	127,617.54	174,404.15
其中：基金申购款	-80,501.42	-16,440.04	-96,941.46
基金赎回款	127,288.03	144,057.58	271,345.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-325,199.32	-1,308,532.72	-1,633,732.04

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	59,990.76
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	2,487.74
其他	199.08
合计	62,677.58

6.4.7.10 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01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	131,692,242.77
减：卖出股票成本总额	137,926,991.25
减：交易费用	286,084.70
买卖股票差价收入	-6,520,833.18

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	163,604.39
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-654.34
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	162,950.05

6.4.7.11.2 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01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	654.34
买卖债券差价收入	-654.34

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益--赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益--申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益**6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益—其他投资收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,871,629.80
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	2,871,629.80

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	8,948,243.55
——股票投资	9,205,719.73
——债券投资	-257,476.18
——资产支持证券投资	-
——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	8,948,243.55

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	26,516.88
合计	26,516.88

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	33,160.92
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,754.25
合计	97,422.54

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金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

本基金本报告期不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。

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
长江证券（上海）资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司(以下简称"长江证券")	基金管理人母公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06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
长江证券	-	-	236,880.00	0.10%

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 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
长江证券	-	-	1,137,300,000.00	31.75%

6.4.10.1.4 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产生应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,843,338.59	2,823,438.32
其中：支付销售机构的客户维护费	875,718.90	1,363,984.55

注：（1）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

（2）基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照基金托管人与基金管理人协商一致的方式于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	245,778.48	376,458.48

注：（1）本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

（2）基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照基金托管人与基金管理人协商一致的方式于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长江红利回报混合型发起式A	长江红利回报混合型发起式C	合计
长江证券股份有限公司	0.00	34,761.76	34,761.76
长江证券（上海）资产管理有限公司	0.00	0.00	0.00
交通银行股份有限公司	0.00	7,093.71	7,093.71
合计	0.00	41,855.47	41,855.47
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长江红利回报混合型发起式A	长江红利回报混合型发起式C	合计
长江证券股份有限公司	0.00	73,330.45	73,330.45
长江证券（上海）资产管理有限公司	0.00	78.37	78.37
交通银行股份有限公司	0.00	9,270.78	9,270.78
合计	0.00	82,679.60	82,679.60

注：（1）本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金C类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提。

C类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times \text{销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

（2）销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照基金托管人与基金管理人协商一致的方式于次月前

五个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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。

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。

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

长江红利回报混合型发起式A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.76%	3.45%

注：（1）本基金管理人运用固有资金投资本基金，适用费率符合基金合同和招募说明书的相关约定；（2）报告期末持有的基金份额占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额总额。

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

本基金本报告期末及上年度末均不存在除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	14,713,336.99	59,990.76	34,845,081.02	373,829.99

注：上述银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按约定利率计息。

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

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年06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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金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为0元，无质押债券。

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，本基金从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0元，无质押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金未持有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

本基金为混合型基金，其预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现"风险和收益相匹配"的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险控制委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由法律合规部、风险管理部负责，组织、协调并与各业务部门共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险控制委员会报告公司风险状况。法律合规部和风险管理部分别由合规总监和首席风险官分管，配置有合规、风控方面专业人员。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人已制定交易对手管理办法，在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估，并在对交易对手资质进行分层的基础上针对业务类型加以分级管控。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，本基金在交易所场内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，因此违约风险可能性很小；在交易所场外及银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	16,022,061.10	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	16,022,061.10	-

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。

本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金运作周期内的每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每个开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，

对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券均在证券交易所上市，持有资产流动性高，本基金可通过卖出资产方式应对流动性需求。本基金管理人每日预测本基金的流动性管理，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的检测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的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。

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现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年06 月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,713,336.99	-	-	-	14,713,336.99
结算备付金	512,932.30	-	-	-	512,932.30
存出保证金	29,259.13	-	-	-	29,259.13

交易性金融资产	16,022,061.10	-	-	173,895,177.51	189,917,238.61
买入返售金融资产	-4,398.63	-	-	-	-4,398.63
应收清算款	-	-	-	13,006,597.95	13,006,597.95
应收申购款	-	-	-	54,558.65	54,558.65
资产总计	31,273,190.89	-	-	186,956,334.11	218,229,525.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	82,104.86	82,104.86
应付管理人报酬	-	-	-	273,333.17	273,333.17
应付托管费	-	-	-	36,444.39	36,444.39
应付销售服务费	-	-	-	7,187.64	7,187.64
应交税费	-	-	-	342.85	342.85
其他负债	-	-	-	263,849.36	263,849.36
负债总计	-	-	-	663,262.27	663,262.27
利率敏感度缺口	31,273,190.89	-	-	186,293,071.84	217,566,262.73
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,595,356.14	-	-	-	19,595,356.14
结算备付金	996,155.39	-	-	-	996,155.39
存出保证金	22,510.16	-	-	-	22,510.16
交易性金融资产	-	-	-	241,735,583.90	241,735,583.90
应收申购款	-	-	-	263.88	263.88
资产总计	20,614,021.69	-	-	241,735,847.78	262,349,869.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	68,847.14	68,847.14
应付管理人报酬	-	-	-	336,472.17	336,472.17
应付托管费	-	-	-	44,862.94	44,862.94
应付销售服务费	-	-	-	8,165.55	8,165.55
其他负债	-	-	-	231,317.52	231,317.52
负债总计	-	-	-	689,665.32	689,665.32

利率敏感度缺口	20,614,021.69	-	-	241,046,182.46	261,660,204.15
---------	---------------	---	---	----------------	----------------

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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06月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率上升25个基点	-85,936.84	-
市场利率下降25个基点	85,936.84	-	

注：上年度末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所及银行间同业市场交易的股票和固定收益品种，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他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种方法对基金进行风险度量，以及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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06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	173,895,177.51	79.93	241,735,583.90	92.39
交易性金融资产 — 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 — 债券投资	16,022,061.10	7.36	-	-
交易性金融资产 — 贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产— 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	189,917,238.61	87.29	241,735,583.90	92.39

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变。		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上涨5%	15,278,038.63	10,946,995.16
	业绩比较基准下跌5%	-15,278,038.63	-10,946,995.16

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，组合业绩比较基准发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	189,917,238.61	241,621,383.44
第二层次	-	-
第三层次	-	114,200.46
合计	189,917,238.61	241,735,583.90

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金无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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2023年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	173,895,177.51	79.68
	其中：股票	173,895,177.51	79.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,022,061.10	7.34
	其中：债券	16,022,061.10	7.34
	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	-4,398.63	0.00
	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	15,226,269.29	6.98
8	其他各项资产	13,090,415.73	6.00
9	合计	218,229,525.00	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,538,053.50	0.71
C	制造业	27,555,570.00	12.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,639,000.00	12.24
E	建筑业	17,077,000.00	7.85
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	16,785,800.00	7.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,820,500.00	2.68
J	金融业	67,479,670.00	31.02
K	房地产业	10,999,584.01	5.06

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	173,895,177.51	79.93

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	230,000	10,672,000.00	4.91
2	601985	中国核电	1,500,000	10,575,000.00	4.86
2	600926	杭州银行	900,000	10,575,000.00	4.86
4	601668	中国建筑	1,700,000	9,758,000.00	4.49
5	000001	平安银行	850,000	9,545,500.00	4.39
6	601601	中国太保	330,000	8,573,400.00	3.94
7	002271	东方雨虹	300,000	8,178,000.00	3.76
8	600548	深高速	900,000	8,082,000.00	3.71
9	601818	光大银行	2,523,500	7,747,145.00	3.56
10	601636	旗滨集团	800,000	6,896,000.00	3.17
11	600027	华电国际	1,000,000	6,690,000.00	3.07
12	601658	邮储银行	1,359,000	6,645,510.00	3.05
13	600016	民生银行	1,552,800	5,823,000.00	2.68
14	600176	中国巨石	400,000	5,664,000.00	2.60
15	601006	大秦铁路	630,000	4,680,900.00	2.15

16	600011	华能国际	500,000	4,630,000.00	2.13
17	601800	中国交建	400,000	4,364,000.00	2.01
18	600000	浦发银行	600,000	4,344,000.00	2.00
19	000002	万科A	300,000	4,206,000.00	1.93
20	601021	春秋航空	70,000	4,022,900.00	1.85
21	600048	保利发展	300,000	3,909,000.00	1.80
22	600886	国投电力	300,000	3,795,000.00	1.74
23	601166	兴业银行	227,100	3,554,115.00	1.63
24	002555	三七互娱	100,000	3,488,000.00	1.60
25	601186	中国铁建	300,000	2,955,000.00	1.36
26	600383	金地集团	400,081	2,884,584.01	1.33
27	600019	宝钢股份	500,000	2,810,000.00	1.29
28	600941	中国移动	25,000	2,332,500.00	1.07
29	603008	喜临门	89,300	2,248,574.00	1.03
30	600309	万华化学	20,025	1,758,996.00	0.81
31	601088	中国神华	50,018	1,538,053.50	0.71
32	600803	新奥股份	50,000	949,000.00	0.44

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	601800	中国交建	6,641,808.00	2.54
2	601088	中国神华	6,407,519.46	2.45
3	600016	民生银行	5,565,000.00	2.13
4	600941	中国移动	5,218,551.00	1.99
5	000799	酒鬼酒	4,517,333.00	1.73
6	600027	华电国际	4,091,000.00	1.56
7	601021	春秋航空	2,955,521.00	1.13
8	002555	三七互娱	2,914,750.00	1.11
9	601186	中国铁建	2,838,500.00	1.08

10	600926	杭州银行	2,620,000.00	1.00
11	601601	中国太保	2,257,785.00	0.86
12	600803	新奥股份	1,879,408.00	0.72
13	600011	华能国际	1,656,800.00	0.63
14	601318	中国平安	1,428,000.00	0.55
15	603378	亚士创能	1,304,971.00	0.50
16	600901	江苏金租	1,238,514.65	0.47
17	603008	喜临门	1,166,500.00	0.45
18	601899	紫金矿业	1,161,400.00	0.44
19	002049	紫光国微	868,240.00	0.33
20	688400	凌云光	852,137.82	0.33

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；（2）本项“买入金额”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。

7.4.2 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	600019	宝钢股份	10,029,334.00	3.83
2	600919	江苏银行	9,770,000.00	3.73
3	601088	中国神华	7,639,968.00	2.92
4	600377	宁沪高速	7,148,992.00	2.73
5	600036	招商银行	5,828,207.00	2.23
6	002216	三全食品	5,725,450.00	2.19
7	002555	三七互娱	5,181,852.00	1.98
8	600660	福耀玻璃	4,545,305.00	1.74
9	601985	中国核电	4,283,800.00	1.64
10	601006	大秦铁路	4,163,200.00	1.59
11	600926	杭州银行	3,969,273.00	1.52
12	300726	宏达电子	3,826,611.00	1.46
13	601166	兴业银行	3,765,476.00	1.44

14	000799	酒鬼酒	3,543,996.00	1.35
15	600941	中国移动	3,427,650.00	1.31
16	600011	华能国际	3,268,195.00	1.25
17	600000	浦发银行	3,256,000.00	1.24
18	600027	华电国际	3,171,710.00	1.21
19	601021	春秋航空	3,075,715.00	1.18
20	600176	中国巨石	2,998,000.00	1.15

注：（1）卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。（2）本项"卖出金额"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。

7.4.3 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	60,880,865.13
卖出股票收入（成交）总额	131,692,242.77

注：（1）买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。（2）"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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	16,022,061.10	7.36
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	16,022,061.10	7.36

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	110053	苏银转债	100,000	12,571,616.44	5.78
2	110079	杭银转债	30,000	3,450,444.66	1.59

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

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本着审慎性原则、在风险可控的前提下，以套期保值策略为目的，适度参与国债期货的投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票，没有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	29,259.13
2	应收清算款	13,006,597.95
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	54,558.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,090,415.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110053	苏银转债	12,571,616.44	5.78
2	110079	杭银转债	3,450,444.66	1.59

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情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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

份额 级别	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
长江红 利回报 混合型 发起式A	3,491	60,174.20	16,535,379.89	7.87%	193,532,743.32	92.13%
长江红 利回报 混合型 发起式C	653	35,011.07	2,416,073.92	10.57%	20,446,156.74	89.43%
合计	4,126	56,454.28	18,951,453.81	8.14%	213,978,900.06	91.86%

注：（1）分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

（2）户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长江红利回报混合 型发起式A	160,189.95	0.08%
	长江红利回报混合 型发起式C	58,100.17	0.25%
	合计	218,290.12	0.09%

注：持有份额总数占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长江红利回报混合型发起式A	0~10
	长江红利回报混合型发起式C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	长江红利回报混合型发起式A	0~10
	长江红利回报混合型发起式C	0~10
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,200.02	4.29%	10,000,200.02	4.29%	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,200.02	4.29%	10,000,200.02	4.29%	-

注：持有份额占基金总份额比例、发起份额占基金总份额比例的计算中，分母采用报告期末基金份额总额。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	长江红利回报混合型发起式A	长江红利回报混合型发起式C

基金合同生效日（2021年11月10日）基金份额总额	440,449,934.09	93,153,922.23
本报告期期初基金份额总额	255,718,858.11	25,900,189.40
本报告期基金总申购份额	8,027,533.31	4,198,304.21
减：本报告期基金总赎回份额	53,678,268.21	7,236,262.95
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	210,068,123.21	22,862,230.66

注：总申购份额含红利再投资份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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

1、本报告期内，自2023年3月27日起，吴迪先生担任长江证券（上海）资产管理有限公司董事会秘书。

2、本报告期内，自2023年3月27日起，陆大明先生担任长江证券（上海）资产管理有限公司财务负责人。

3、本报告期内，自2023年4月7日起，张耘女士担任长江证券（上海）资产管理有限公司副总经理。

4、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理和基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内继续选聘中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

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，本基金管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
东方证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	2,262,368.00	1.18%	1,654.50	1.19%	-
兴业证券	1	105,381,750.56	54.78%	76,009.29	54.59%	-
浙商证券	1	20,286,223.82	10.55%	14,632.32	10.51%	-
中金公司	1	44,202,667.44	22.98%	32,324.76	23.21%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	5,578,240.88	2.90%	4,023.52	2.89%	-
广发证券	2	2,885,844.00	1.50%	2,110.44	1.52%	-
国金证券	2	11,773,214.00	6.12%	8,491.95	6.10%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于2亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；

(4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
 (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金公司进行证券交易的需要，并能为基金公司提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金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，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

我司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象，并签订交易单元租用协议。公司的投资和研究部门定期对所选证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供宏观、行业、策略、专题、公司等研究报告的质量和数量；组织相关研讨会议的数量和质量；协助安排上市公司调研的质量和数量；主动进行上门路演和反路演的数量和质量；以及其他及时性及提供研究服务主动性和质量等情况。最终公司统一依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。

3、本报告期内，本基金租用的券商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	
	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
东方证券	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-
兴业证券	16,357,932.89	100.00%	206,000,000.00	67.32%
浙商证券	-	-	-	-
中金公司	-	-	95,000,000.00	31.05%
长江证券	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-
国金证券	-	-	5,000,000.00	1.63%

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	长江证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司	规定报刊、网站	2023-01-07

	公司基金申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告		
2	长江红利回报混合型发起式证券投资基金2022年第四季度报告	规定网站	2023-01-20
3	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金2022年第四季度报告提示性公告	规定报刊	2023-01-20
4	长江证券（上海）资产管理有限公司关于防范不法分子冒用公司员工名义进行非法活动的重要提示	规定报刊、网站	2023-03-22
5	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2023-03-29
6	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2023-03-29
7	长江红利回报混合型发起式证券投资基金2022年年度报告	规定网站	2023-03-31
8	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金2022年年度报告提示性公告	规定报刊、网站	2023-03-31
9	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2023-04-08
10	长江红利回报混合型发起式证券投资基金2023年第一季度报告	规定网站	2023-04-21
11	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金2023年第一季度报告提示性公告	规定报刊、网站	2023-04-21
12	长江证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金参加腾安基金销售（深圳）有限公司基金申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	规定报刊、网站	2023-05-09
13	长江证券（上海）资产管理有限公司关于公司董事变更的公告	规定报刊、网站	2023-06-03
14	长江证券（上海）资产管理有限公司关于开展网上服务系统应急演练的公告	规定报刊、网站	2023-06-15

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予长江红利回报混合型发起式证券投资基金募集申请的注册文件
- 2、长江红利回报混合型发起式证券投资基金基金合同
- 3、长江红利回报混合型发起式证券投资基金招募说明书
- 4、长江红利回报混合型发起式证券投资基金托管协议
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、本报告期内按照规定披露的各项公告

11.2 存放地点

存放地点为基金管理人办公地址：上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公地点免费查阅，亦可通过基金管理人网站查阅，网址为www.cjzcgf.com。

长江证券（上海）资产管理有限公司
二〇二三年八月三十一日