

景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置  
混合型证券投资基金  
2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 4 月 22 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合  |
| 基金主代码      | 009598  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2020 年 6 月 30 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 160,080,154.99 份  |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。通过精选具有良好持续成长潜力的科创主题的上市公司，力争实现基金资产的长期稳健增值。  |
| 投资策略       | <p>1、资产配置策略：本基金综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素并结合基金合同、投资制度等要求提出资产配置的建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>2、科技创新主题的界定：本基金主要投资于“科技创新”相关主题的证券。科技创新企业定位于面向世界科技前沿、面向经济主战场、面向国家重大需求的科技创新企业，以及符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业。</p> <p>3、战略配售投资策略：封闭期内，本基金将积极关注、深入分析并论证战略配售股票的投资机会，通过综合分析行业景气度等多方面因素，结合未来市场走势判断，精选战略配售股票。本基金对战略配售股票的公司基本面的衡量主要侧重公司所在行业的发展特点及公司的行业地位、公司的核心竞争力、公司的经营能力和治理结构等方面。本基金在开放期内不得参与战略配售。</p> <p>本基金剩余封闭期应长于战略配售股票的锁定期及减持期。</p> <p>4、股票投资策略：一是从行业布局、精选个股层面进行考虑科创板股票投资策略。二是灵活调整股票资产配置比例。</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>5、债券投资策略：债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>6、资产支持证券投资策略：本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。</p> <p>7、股指期货投资策略：本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。</p> <p>8、国债期货投资策略：本基金可基于谨慎原则，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>9、股票期权投资策略：本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p>10、港股通标的股票投资策略：本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，通过港股通机制投资于香港股票市场。本基金将遵循上述股票投资策略，并结合香港市场特点，选取符合本基金投资目标的优质港股企业。</p> <p>11、为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可参与融资业务。为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，封闭期内，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。</p> |
| 业绩比较基准 | 中国战略新兴产业成份指数收益率*50%+恒生指数收益率*10%+中债综合指数收益率*40%  |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金以战略配售为投资策略，需参与并接受发行人战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。本基金还可投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>  |
| 基金管理人  | 景顺长城基金管理有限公司   |
| 基金托管人  | 招商银行股份有限公司   |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

|        |                           |
|--------|---------------------------|
| 主要财务指标 | 报告期（2024年1月1日-2024年3月31日） |
|--------|---------------------------|

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 1. 本期已实现收益      | -12,149,957.79 |
| 2. 本期利润         | -7,814,337.23  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0488        |
| 4. 期末基金资产净值     | 93,079,558.60  |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.5814         |

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、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。

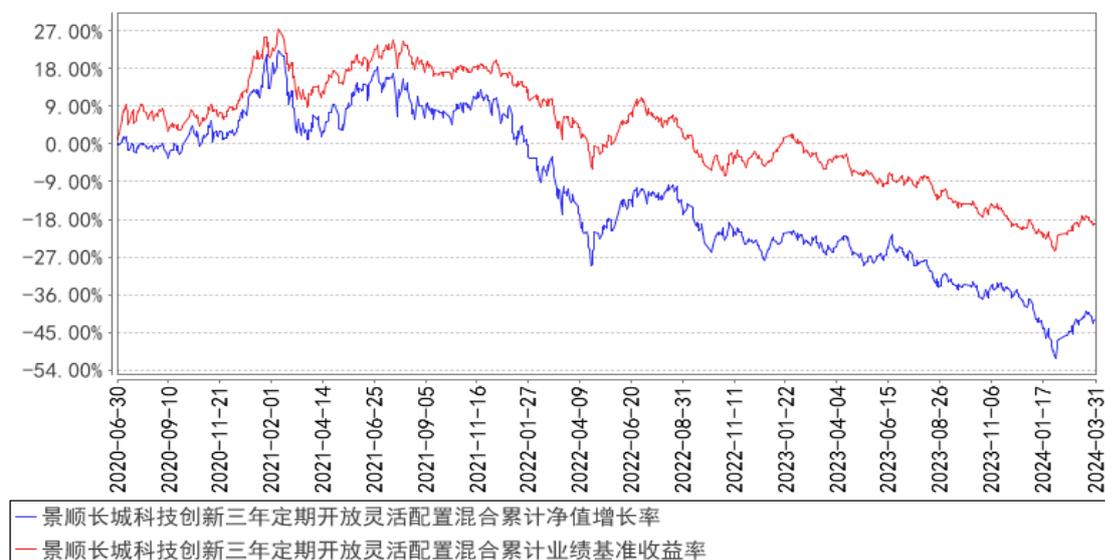
## 3.2 基金净值表现

### 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             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | -7.74%     | 1.79%         | -1.31%         | 0.96%                 | -6.43%  | 0.83% |
| 过去六个月          | -12.45%    | 1.49%         | -5.85%         | 0.84%                 | -6.60%  | 0.65% |
| 过去一年           | -22.48%    | 1.31%         | -16.30%        | 0.77%                 | -6.18%  | 0.54% |
| 过去三年           | -44.16%    | 1.38%         | -28.04%        | 0.84%                 | -16.12% | 0.54% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -41.86%    | 1.35%         | -19.17%        | 0.89%                 | -22.69% | 0.46% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例如下：开放期内，本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0%—95%；封闭期内，本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0%—100%。在开放期和封闭期内，本基金投资于科技创新主题相关的证券资产占非现金资产的比例不低于 80%，投资港股通标的股票最高投资比例不得超过股票资产的 50%。本基金投资于同业存单比例不超过基金资产的 20%。开放期内，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的建仓期为自 2020 年 6 月 30 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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务       | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|----------|-----------------|------|--------|---|
|    |          | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 詹成 | 本基金的基金经理 | 2020 年 6 月 30 日 | -    | 13 年   | 通信电子工程博士。曾任英国诺基亚研发中心研究员。2011 年 7 月加入本公司，历任研究部研究员、专户投资部投资经理，自 2015 年 12 月起担任股票投资部基金经理，现任研究部副总经理、股票投资部基金经理。具有 13 年证券、基金行业从业经验。      |
| 郭琳 | 本基金的基金经理 | 2022 年 7 月 12 日 | -    | 10 年   | 理学硕士。曾任大成国际资产管理有限公司投资研究部高级研究员。2016 年 8 月加入本公司，历任研究部研究员、专户投资部投资经理、研究部基金经理助理，自 2022 年 7 月起担任股票投资部基金经理，现任研究部基金经理。具有 10 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。

#### 4.1.1 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、《景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 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 6 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年一季度，市场经历了大幅的波动，情绪由开年的悲观、超跌、再到企稳修复，国内经济也体现出相似的态势，内需较为疲软，消费呈现结构分化的特点，地产基建的拉动效应不足，外需出口态势良好，部分制造业也体现出增长的韧性。进入年报一季报披露期，部分行业企业体现出良好的增长韧性，同时更加注重股东回报。

一季度，基金仓位维持在相对高的水平，选股逻辑和投资理念没有发生变化，聚焦在数字经济、成长领域，优选符合产业趋势、具备核心竞争优势的企业；同时我们更注重企业的自由现金流、股东回报和估值水平。在当前市场环境中，具备现金流的公司更能抵御市场波动和经营波动

的风险。在行业的调整上，增加了部分 AI 相关板块仓位，主要由于海外科技巨头引领的产业趋势在逐步的超预期，硬件算力的技术升级、大模型的持续迭代、应用端的百花齐放形成了正向的循环，国内的发展也在持续追赶，国产算力得到政策的支持，图文视频的应用也频出爆款，我们看好 AI 产业趋势相关的投资机会；降低了部分互联网、消费领域个股，顺周期领域复苏节奏有所推后；增加了有色行业的仓位，全球定价的资源品在供给端较为紧张，且较长的时间维度上供给无法有效释放，需求端海外随着下半年美国降息需求将进一步确认，国内需求也有企稳复苏迹象，供需错配的情况下价格具备向上弹性，优选具备全球竞争力的跨国矿业集团进行布局；优化了部分医药行业的仓位，过去 3 年医药板块调整较为充分，板块持仓和估值均处于相对低位，优选个股。

一季度报告期内，沪深 300 指数上涨 3.10%，中小 100 指数、创业板指数分别下跌 3.78%、3.87%。行业方面表现分化，根据申万一级行业指数，银行(+10.60%)、石油石化(+10.58%)、煤炭(+10.46%)表现突出；成长板块跌幅居前。港股方面，恒生指数下跌 2.97%，恒生国企指数上涨 0.73%，恒生科技指数下跌 7.62%。

展望未来，我们对权益市场仍然保持乐观，当前市场的调整消化了大部分的悲观预期，估值具备性价比，经济增长从总量向结构高质量发展转型，科技成长的产业趋势仍在推进。后续我们依然看好的方向：第一，数字经济的政策力度高度空前，新基建成为整体经济重要的拉动力量，产业数字化和数字产业化双管齐下；第二，随着海外国内科技巨头在人工智能领域的创新突破，我们认为 2024 年 AI 的产业趋势持续加速，算力、应用及终端均有机会，从而也带动消费电子及半导体的投资机会；第三，自主可控，科技自立自強会是中长期不变的发展方向，核心领域逐一突破；第四，看好受益于出口的具备全球竞争力制造业龙头企业，以及顺应人口老龄化需求的医药行业。

投资策略上，我们依然坚定围绕科技创新方向来构建组合，每个时代有每个时代的特征，科技创新是中国未来 5-10 年最强 alpha 的产业方向。具体看好方向包括：

#### 1、人工智能：

随着海外国内巨头在人工智能领域的创新突破，我们认为其对数字产业化和产业数字化均有较大拉动。节奏上，海外催化剂不断落地，算力芯片快速迭代降本，拉动大模型迭代需求和应用创新，AI 终端产品也陆续推出。具体来看：

(1) 应用端：AI 应用端在图、文、视频领域有多点开花趋势，尤其是生产力工具上的应用得以推广。垂直应用厂商推出特定领域的大模型，专注优化 C 端用户体验、解决 B 端降本提效痛点。为游戏、动画、广告营销、数字人、智能客服、教育、办公等众多领域，带来显著改变。

我们会结合估值和海外应用端映射来选择投资标的，中长期看好应用落地带来的业绩增长。

(2) 算力端：优选海外芯片巨头的国内合作伙伴，具备全球化供应链能力；国产算力也在加速追赶，尤其是推理端需求较为强劲。

(3) 硬件创新：2024 年端侧 AI 部署将成为大势所趋，手机和 PC 作为日常使用频次最高、使用时长最长的交互工具，为当下最佳的 AI 终端载体，且满足本地运行大模型保护个人隐私的需求。伴随着主芯片厂商新一代具备 AI 功能的产品推出，以及开源的 AI 大模型推广，终端的迭代会加速，从而拉动手机和 PC 的换机需求和部分消费电子的结构性机会。同时，AI 在泛娱乐场景的应用加速，MR、AR 的混合现实交互体验走向市场，海外大厂的产品优先推出，0 到 1 的突破带来供应链的投资机会。

## 2、数字产业化：

在当前宏观背景下，数字经济成为整体经济的重要拉动力量。其中重点包括算力基建、半导体自主可控等。随着 AI 产业链蓬勃发展，AIGC 拉动新一轮算力投资，“军备竞赛”背景下硬件基础设施率先受益，叠加传统数据中心资本开支周期逐步触底，产业链有望延续 2023 年的高景气度，国产算力在 2024 年将有所突破。运营商也在数字经济中起到领头羊作用，数据要素、云计算、国家算力方向都在积极推进。

在自主可控方面，当前半导体景气度周期逐步见底，资本开支有望率先企稳向上。国内现阶段半导体制造产能自给率尚低，逆周期实施产能扩张，资本开支相对海外占优。叠加地缘政治等非市场因素影响，全球制造业回流，特别是半导体制造为代表重资产环节，产能过剩投资阶段利好上游供应链需求。当前时代背景下国产替代的迫切性已不可同日而语。新型举国体制推进核心技术攻坚，政策、客户、供应链协同发展，加速国内上游设备及材料厂商的技术迭代，部分环节在技术水平及成本竞争上对比国际领先厂商已具备竞争优势。

## 3、高端制造出口线：

2024 年美国通胀压力有望缓解，海外降息也是大概率事件，降息环境中，预计在工业端和居民端会出现的补库需求、资本开支需求、购房需求，对应拉动出口产业链的投资机会。重点关注机械行业、医药行业、电子行业的出口链投资机会。这些领域可以通过高频数据的跟踪，和订单等前置指标的变化来判断节奏。

从估值来看，高端制造领域出口链前期调整较多，估值大多数处于历史分位数偏低水平，存在结构性低估的机会。

## 4、复苏主线：

港股互联网为复苏主线代表，经历了政策规范、退市风险、疫情封控、中美博弈等多重利空

后，估值处于历史底部区域，但业绩却在 2022 年二季度触底后步入回升区间。当前行业存在众多催化剂：一是流动性有望改善，港股资金自由流动，美国加息对港股流动性影响显著，当前美国加息接近尾声，流动性改善将有效改善港股互联网公司估值水平；二是 AI 浪潮大时代下，大模型有望带来商业模式的革新和明显的业务增量，而港股互联网公司具有领先同业的科技实力，拥有最丰富的应用场景和优质数据，是大模型最有实力的竞争者。因此，港股互联网催化众多，业绩与估值均有弹性，存在科技变化带来的向上期权。

高估值肯定是回报率的敌人，透支未来价值很多的公司，我们会规避，组合构建的时候会保持一定的均衡性，尽可能地降低净值的波动，追求复利，积小胜为大胜，希望能够在中长期的维度为持有人创造稳定的净值增长。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2024 年 1 季度，本基金份额净值增长率为-7.74%，业绩比较基准收益率为-1.31%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 84,718,716.11 | 90.29        |
|    | 其中：股票             | 84,718,716.11 | 90.29        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | -             | -            |
|    | 其中：债券             | -             | -            |
|    | 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      | 8,878,825.90  | 9.46         |
| 8  | 其他资产              | 233,223.99    | 0.25         |
| 9  | 合计                | 93,830,766.00 | 100.00       |

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 15,676,863.26 元，占基金资产净值的比例为 16.84%。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 5.2.1 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              | 4,682,212.00  | 5.03         |
| C  | 制造业              | 51,868,170.41 | 55.72        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,739,924.00  | 2.94         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 7,202,866.44  | 7.74         |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| 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        | 2,548,680.00  | 2.74         |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 69,041,852.85 | 74.18        |

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币）     | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|---------------|--------------|
| 原材料     | 4,156,323.24  | 4.47         |
| 周期性消费品  | 1,200,852.39  | 1.29         |
| 非周期性消费品 | 1,649,014.45  | 1.77         |
| 综合      | -             | -            |
| 能源      | 1,284,871.45  | 1.38         |
| 金融      | -             | -            |
| 基金      | -             | -            |
| 工业      | -             | -            |
| 信息技术    | 444,010.06    | 0.48         |
| 公用事业    | -             | -            |
| 通讯      | 6,941,791.67  | 7.46         |
| 合计      | 15,676,863.26 | 16.84        |

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

**5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

| 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  | 688012 | 中微公司 | 27,475  | 4,102,017.50 | 4.41         |
| 2  | 00700  | 腾讯控股 | 13,064  | 3,597,954.80 | 3.87         |
| 3  | 603993 | 洛阳钼业 | 217,800 | 1,812,096.00 | 1.95         |
| 3  | 03993  | 洛阳钼业 | 264,000 | 1,591,539.18 | 1.71         |
| 4  | 600183 | 生益科技 | 194,500 | 3,351,235.00 | 3.60         |
| 5  | 000403 | 派林生物 | 111,600 | 3,140,424.00 | 3.37         |
| 6  | 000550 | 江铃汽车 | 103,271 | 3,117,751.49 | 3.35         |
| 7  | 600026 | 中远海能 | 162,800 | 2,739,924.00 | 2.94         |
| 8  | 002517 | 恺英网络 | 233,800 | 2,576,476.00 | 2.77         |
| 9  | 688019 | 安集科技 | 17,601  | 2,405,176.65 | 2.58         |
| 10 | 300567 | 精测电子 | 30,200  | 2,203,090.00 | 2.37         |

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券投资。

**5.5 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债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券投资。

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资  
明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**5.7 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。

**5.8 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权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

1、时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、

和技术指标等因素。

2、套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

3、合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 19,854.67  |
| 2  | 应收证券清算款 | 213,369.32 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 7 | 其他 | -            |
| 8 | 合计 | 233, 223. 99 |

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告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。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                   |
|---------------------------|-------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 160, 080, 154. 99 |
| 报告期期间基金总申购份额              | -                 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | -                 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                 |
| 报告期期末基金份额总额               | 160, 080, 154. 99 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本期末未运用固有资金投资本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期末未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 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。

#### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；

2、《景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

### 9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 9.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2024 年 4 月 22 日