

景顺长城量化新动力股票型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
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
§ 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
§ 5 托管人报告	11
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真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49

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	49
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	49
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	49
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化新动力股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城量化新动力股票
场内简称	无
基金主代码	001974
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 7 月 13 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	379,461,902.29 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：本基金主要采用超额收益模型、风险模型、成本模型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	MSCI 中国 A 股国际指数(MSCI China A International Index) 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95588

传真	0755-22381339	(010) 66105798
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	李进	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-8,657,914.08
本期利润	2,963,000.18
加权平均基金份额本期利润	0.0075
本期加权平均净值利润率	0.43%
本期基金份额净值增长率	0.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	273,852,611.38
期末可供分配基金份额利润	0.7217
期末基金资产净值	668,284,199.33
期末基金份额净值	1.761
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	76.10%

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。

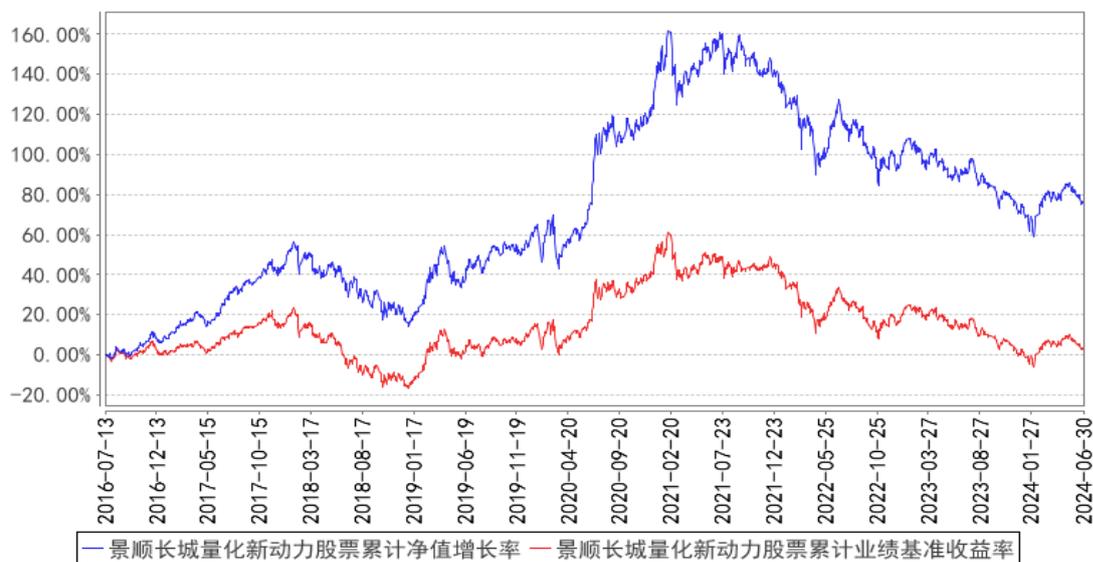
3.2 基金净值表现

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	-2.92%	0.49%	-3.69%	0.49%	0.77%	0.00%
过去三个月	-1.34%	0.72%	-2.49%	0.75%	1.15%	-0.03%
过去六个月	0.46%	0.92%	-0.07%	0.94%	0.53%	-0.02%
过去一年	-7.61%	0.82%	-9.94%	0.86%	2.33%	-0.04%
过去三年	-31.66%	0.98%	-31.65%	0.99%	-0.01%	-0.01%
自基金合同生效起至今	76.10%	1.09%	2.57%	1.07%	73.53%	0.02%

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

景顺长城量化新动力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：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 2016 年 7 月 13 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2024年6月30日，本公司旗下共管理184只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黎海威	本基金的基金经理	2016年7月13日	-	21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21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、《景顺长城量化新动力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 9 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 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

2024 年上半年，国内经济在经历了一季度的亮眼开局之后出现一定的边际走弱，较强的出口数据带动工业生产保持韧性，内需在地产持续下行、居民预期偏弱的背景下仍旧疲弱。从数据来看，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 50.4、49.5、49.5，5、6 两月 PMI 重新跌入收缩区间。今年前 6 个月工业增加值累计同比增长 6.0%，其中 6 月份工业增加值当月同比增长 5.3%，经济延续弱复苏的格局。6 月 CPI 同比上升 0.2%，环比下降 0.2%；PPI 同比下降 0.8%，环比下降 0.2%，价格类指标依旧偏弱。6 月 M2 同比增长 6.2%，M1 同比下降 5.0%，信贷需求仍然偏弱；6 月末外汇储备 3.22 万亿美元，汇率短期承压。整体而言，国内经济依然处于弱复苏的态势，“稳增长”政策的效果正在逐步显现。上半年 A 股市场震荡调整，结构有所分化，上证指数下跌 0.25%，沪深 300 指数上涨 0.89%，创业板指数下跌 10.99%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年上半年，本基金份额净值增长率为 0.46%，业绩比较基准收益率为-0.07%。

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 2024 年下半年，海外方面，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，我们认为三季度国内经济环比二季度大概率能够边际回升，前期政策的累积效应以及新的“稳增长”政策对经济形成一定支撑；新“国九条”的推出将会改善股市微观供需结构，并进一步提升 A 股市场的投资价值。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。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成长稳健的公司，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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城量化新动力股票型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	38,384,356.11	40,397,922.55
结算备付金		6,567,429.15	6,336,011.02
存出保证金		68,606.98	64,765.35
交易性金融资产	6.4.7.2	626,407,240.46	674,715,285.20

其中：股票投资		626,407,240.46	674,715,285.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	167,316.22
应收股利		-	-
应收申购款		54,816.88	55,628.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		671,482,449.58	721,736,928.90
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		1,004,184.57	1,112,263.74
应付管理人报酬		672,631.92	733,823.19
应付托管费		112,105.35	122,303.84
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,409,328.41	1,559,394.20
负债合计		3,198,250.25	3,527,784.97
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	379,461,902.29	409,612,919.42
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	288,822,297.04	308,596,224.51
净资产合计		668,284,199.33	718,209,143.93
负债和净资产总计		671,482,449.58	721,736,928.90

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.761 元，基金份额总额 379,461,902.29 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化新动力股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,890,478.74	-5,974,814.08
1. 利息收入		125,902.94	159,575.92
其中：存款利息收入	6.4.7.13	125,902.94	159,575.92
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,884,855.93	-3,110,658.51
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-12,514,693.68	-16,231,409.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	36.29
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	8,629,837.75	13,120,714.68
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	11,620,914.26	-3,172,001.51
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	28,517.47	148,270.02
减：二、营业总支出		4,927,478.56	8,453,842.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,142,062.19	7,152,022.83
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	690,343.71	1,192,003.87

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. 12
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	95, 072. 66	109, 815. 94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2, 963, 000. 18	-14, 428, 656. 84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2, 963, 000. 18	-14, 428, 656. 84
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2, 963, 000. 18	-14, 428, 656. 84

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城量化新动力股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	409, 612, 919. 42	-	308, 596, 224. 51	718, 209, 143. 93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	409, 612, 919. 42	-	308, 596, 224. 51	718, 209, 143. 93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-30, 151, 017. 13	-	-19, 773, 927. 47	-49, 924, 944. 60
（一）、综合收益总额	-	-	2, 963, 000. 18	2, 963, 000. 18
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-30, 151, 017. 13	-	-22, 736, 927. 65	-52, 887, 944. 78

其中：1. 基金申购款	8,946,890.81	-	6,685,084.56	15,631,975.37
2. 基金赎回款	-39,097,907.94	-	-29,422,012.21	-68,519,920.15
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	379,461,902.29	-	288,822,297.04	668,284,199.33
项目	上年度可比期间			
	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	518,513,438.99	-	488,068,562.39	1,006,582,001.38
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	518,513,438.99	-	488,068,562.39	1,006,582,001.38
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-65,111,765.74	-	-77,296,261.94	-142,408,027.68
(一)、综合收益总额	-	-	-14,428,656.84	-14,428,656.84
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-65,111,765.74	-	-62,867,605.10	-127,979,370.84
其中：1. 基金申购款	23,145,913.03	-	23,409,881.38	46,555,794.41
2. 基金赎回款	-88,257,678.77	-	-86,277,486.48	-174,535,165.25
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	453,401,673.25	-	410,772,300.45	864,173,973.70

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

景顺长城量化新动力股票型证券投资基金(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[2015]第 1537 号《关于准予景顺长城量化新动力股票型证券投资基金注册的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化新动力股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 219,177,460.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 891 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城量化新动力股票型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 219,324,726.66 份基金份额,其中认购资金利息折合 147,266.66 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化新动力股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为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、资产支持性证券、股指期货以及经中国证监会批准的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：MSCI 中国 A 股国际指数(MSCI China A International Index)收益率 X95%+商业银行活期存款利率(税后)X5%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2024 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于

上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前(如适用)运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起(如适用)产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	38,384,356.11
等于：本金	38,381,022.61
加：应计利息	3,333.50
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	38,384,356.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	641,391,851.34	-	626,407,240.46	-14,984,610.88
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	641,391,851.34	-	626,407,240.46	-14,984,610.88

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	124.40
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,314,722.35
其中：交易所市场	1,314,722.35
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,481.66
合计	1,409,328.41

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	409,612,919.42	409,612,919.42
本期申购	8,946,890.81	8,946,890.81
本期赎回（以“-”号填列）	-39,097,907.94	-39,097,907.94
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	379,461,902.29	379,461,902.29

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	303,106,669.62	5,489,554.89	308,596,224.51
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	303,106,669.62	5,489,554.89	308,596,224.51
本期利润	-8,657,914.08	11,620,914.26	2,963,000.18
本期基金份额交易产生的变动数	-20,596,144.16	-2,140,783.49	-22,736,927.65
其中：基金申购款	6,089,246.92	595,837.64	6,685,084.56
基金赎回款	-26,685,391.08	-2,736,621.13	-29,422,012.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	273,852,611.38	14,969,685.66	288,822,297.04

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入	69,112.85	
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	56,277.42	
其他	512.67	
合计	125,902.94	

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-12,514,693.68	
股票投资收益——赎回差价收入	-	
股票投资收益——申购差价收入	-	
股票投资收益——证券出借差价收入	-	
合计	-12,514,693.68	

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	1,563,630,712.24	
减：卖出股票成本总额	1,572,258,078.48	
减：交易费用	3,887,327.44	
买卖股票差价收入	-12,514,693.68	

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,629,837.75
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	8,629,837.75

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	11,620,914.26
股票投资	11,620,914.26
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	11,620,914.26

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	28,017.87
基金转换费收入	499.60
合计	28,517.47

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	591.00
合计	95,072.66

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
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：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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	102,605,518.40	3.34	35,720,224.95	0.70

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	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	97,054.42	3.34	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	33,266.77	0.70	33,266.77	1.63

注：1. 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。

2. 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,142,062.19	7,152,022.83
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,829,354.85	3,131,446.93
应支付基金管理人的净管理费	2,312,707.34	4,020,575.90

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

根据《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》，自 2023 年 8 月 22 日起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.2\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	690,343.71	1,192,003.87

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

根据《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》，自 2023 年 8 月 22 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期	38,384,356.11	69,112.85	57,318,210.23	107,448.82

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证	成功	受限	流通	认购	期末	数量	期末	期末估值	备注

代码	券名称	认购日	期	受限类型	价格	估值单价	(单位:股)	成本总额	总额	
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024年6月3日	1-6个月(含)	新股流通受限	-	15.25	40	-	610.00	转增股
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024年5月22日	1-6个月(含)	新股流通受限	-	91.24	43	-	3,923.32	转增股
301539	宏鑫科	2024年4月3日	6个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-

	技									
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月以上	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-

603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于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 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖

出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易

的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	38,384,356.11	-	-	-	-	-	38,384,356.11
结算备付金	6,567,429.15	-	-	-	-	-	6,567,429.15
存出保证金	68,606.98	-	-	-	-	-	68,606.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	626,407,240.46	626,407,240.46
应收申购款	-	-	-	-	-	54,816.88	54,816.88
资产总计	45,020,392.24	-	-	-	-	626,462,057.34	671,482,449.58
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,004,184.57	1,004,184.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	672,631.92	672,631.92
应付托管费	-	-	-	-	-	112,105.35	112,105.35
其他负债	-	-	-	-	-	1,409,328.41	1,409,328.41
负债总计	-	-	-	-	-	3,198,250.25	3,198,250.25
利率敏感度缺口	45,020,392.24	-	-	-	-	-	-
上年度末 2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产							
货币资金	40,397,922.55	-	-	-	-	-	40,397,922.55
结算备付金	6,336,011.02	-	-	-	-	-	6,336,011.02
存出保证金	64,765.35	-	-	-	-	-	64,765.35
交易性金融资产	-	-	-	-	-674,715,285.20	674,715,285.20	
应收申购款	-	-	-	-	55,628.56	55,628.56	
应收清算款	-	-	-	-	167,316.22	167,316.22	
资产总计	46,798,698.92	-	-	-	-674,938,229.98	721,736,928.90	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	1,112,263.74	1,112,263.74	
应付管理人报酬	-	-	-	-	733,823.19	733,823.19	
应付托管费	-	-	-	-	122,303.84	122,303.84	
其他负债	-	-	-	-	1,559,394.20	1,559,394.20	
负债总计	-	-	-	-	3,527,784.97	3,527,784.97	
利率敏感度缺口	46,798,698.92	-	-	-	-	-	

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	626,407,240.46	93.73	674,715,285.20	93.94
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	626,407,240.46	93.73	674,715,285.20	93.94

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	31,611,594.06	29,773,617.52
	沪深 300 指数下降 5%	-31,611,594.06	-29,773,617.52

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	626,138,502.76	673,633,262.46
第二层次	55,385.83	25,058.16
第三层次	213,351.87	1,056,964.58
合计	626,407,240.46	674,715,285.20

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	626,407,240.46	93.29
	其中：股票	626,407,240.46	93.29
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	44,951,785.26	6.69
8	其他各项资产	123,423.86	0.02
9	合计	671,482,449.58	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	2,633,522.00	0.39

B	采矿业	39,083,175.00	5.85
C	制造业	342,678,831.27	51.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,711,627.34	4.60
E	建筑业	11,867,077.48	1.78
F	批发和零售业	4,050,746.00	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	28,092,041.50	4.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,277,343.56	3.63
J	金融业	119,508,060.95	17.88
K	房地产业	6,089,951.36	0.91
L	租赁和商务服务业	4,611,401.00	0.69
M	科学研究和技术服务业	601,893.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	1,367,559.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,205,872.00	0.48
R	文化、体育和娱乐业	7,494,379.00	1.12
S	综合	133,760.00	0.02
	合计	626,407,240.46	93.73

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	600519	贵州茅台	22,470	32,972,253.30	4.93
2	300750	宁德时代	75,660	13,621,069.80	2.04
3	601318	中国平安	294,824	12,193,920.64	1.82
4	601166	兴业银行	625,900	11,028,358.00	1.65
5	300760	迈瑞医疗	37,415	10,884,397.65	1.63
6	600900	长江电力	358,100	10,356,252.00	1.55
7	000858	五粮液	73,300	9,385,332.00	1.40
8	600887	伊利股份	263,000	6,795,920.00	1.02
9	603501	韦尔股份	67,385	6,696,047.45	1.00
10	000651	格力电器	163,900	6,428,158.00	0.96
11	601601	中国太保	221,900	6,182,134.00	0.93
12	601816	京沪高铁	1,126,700	6,050,379.00	0.91
13	601211	国泰君安	443,900	6,014,845.00	0.90
14	600036	招商银行	174,661	5,971,659.59	0.89
15	002594	比亚迪	23,000	5,755,750.00	0.86

16	600030	中信证券	304,700	5,554,681.00	0.83
17	601009	南京银行	531,700	5,524,363.00	0.83
18	000568	泸州老窖	35,200	5,050,848.00	0.76
19	600050	中国联通	1,065,000	5,005,500.00	0.75
20	603160	汇顶科技	72,300	4,970,625.00	0.74
21	000725	京东方 A	1,198,000	4,899,820.00	0.73
22	002001	新和成	248,800	4,776,960.00	0.71
23	002371	北方华创	14,905	4,767,960.45	0.71
24	000338	潍柴动力	286,700	4,656,008.00	0.70
25	601658	邮储银行	915,700	4,642,599.00	0.69
26	600029	南方航空	775,200	4,565,928.00	0.68
27	601127	赛力斯	50,000	4,556,000.00	0.68
28	688036	传音控股	58,040	4,442,381.60	0.66
29	600150	中国船舶	108,100	4,400,751.00	0.66
30	600309	万华化学	53,700	4,342,182.00	0.65
31	601668	中国建筑	808,500	4,293,135.00	0.64
32	000063	中兴通讯	153,200	4,285,004.00	0.64
33	688008	澜起科技	73,966	4,227,896.56	0.63
34	600926	杭州银行	318,600	4,157,730.00	0.62
35	600989	宝丰能源	237,800	4,121,074.00	0.62
36	601633	长城汽车	162,200	4,103,660.00	0.61
37	601688	华泰证券	317,360	3,932,090.40	0.59
38	601916	浙商银行	1,419,050	3,916,578.00	0.59
39	601328	交通银行	508,500	3,798,495.00	0.57
40	002128	电投能源	179,500	3,787,450.00	0.57
41	600642	申能股份	423,684	3,741,129.72	0.56
42	600011	华能国际	387,100	3,723,902.00	0.56
43	600177	雅戈尔	518,600	3,692,432.00	0.55
44	300896	爱美客	21,160	3,641,636.00	0.54
45	002475	立讯精密	92,300	3,628,313.00	0.54
46	601939	建设银行	488,900	3,617,860.00	0.54
47	000630	铜陵有色	995,100	3,592,311.00	0.54
48	600000	浦发银行	427,700	3,519,971.00	0.53
49	600566	济川药业	109,100	3,459,561.00	0.52
50	300144	宋城演艺	430,700	3,458,521.00	0.52
51	600346	恒力石化	245,823	3,429,230.85	0.51
52	600489	中金黄金	228,260	3,378,248.00	0.51
53	600938	中国海油	102,200	3,372,600.00	0.50
54	600737	中粮糖业	347,400	3,331,566.00	0.50
55	601128	常熟银行	433,340	3,280,383.80	0.49
56	601717	郑煤机	221,300	3,275,240.00	0.49
57	601058	赛轮轮胎	232,900	3,260,600.00	0.49
58	601665	齐鲁银行	651,000	3,196,410.00	0.48

59	002557	洽洽食品	112,800	3,179,832.00	0.48
60	002948	青岛银行	938,100	3,161,397.00	0.47
61	600276	恒瑞医药	81,900	3,149,874.00	0.47
62	600809	山西汾酒	14,600	3,078,848.00	0.46
63	300015	爱尔眼科	298,000	3,075,360.00	0.46
64	300251	光线传媒	352,400	2,963,684.00	0.44
65	600406	国电南瑞	118,700	2,962,752.00	0.44
66	601669	中国电建	520,400	2,909,036.00	0.44
67	002422	科伦药业	95,800	2,905,614.00	0.43
68	601615	明阳智能	303,900	2,868,816.00	0.43
69	600845	宝信软件	89,600	2,860,928.00	0.43
70	600219	南山铝业	744,500	2,836,545.00	0.42
71	300122	智飞生物	98,500	2,760,955.00	0.41
72	000333	美的集团	42,800	2,760,600.00	0.41
73	603993	洛阳钼业	322,000	2,737,000.00	0.41
74	600985	淮北矿业	160,500	2,686,770.00	0.40
75	002352	顺丰控股	74,600	2,662,474.00	0.40
76	002027	分众传媒	438,700	2,658,522.00	0.40
77	601666	平煤股份	233,800	2,618,560.00	0.39
78	600690	海尔智家	91,600	2,599,608.00	0.39
79	600019	宝钢股份	383,600	2,550,940.00	0.38
80	600584	长电科技	78,000	2,473,380.00	0.37
81	600660	福耀玻璃	51,500	2,466,850.00	0.37
82	601225	陕西煤业	95,100	2,450,727.00	0.37
83	000166	申万宏源	529,700	2,283,007.00	0.34
84	600886	国投电力	123,900	2,259,936.00	0.34
85	601628	中国人寿	71,800	2,229,390.00	0.33
86	002410	广联达	231,700	2,219,686.00	0.33
87	601877	正泰电器	115,370	2,198,952.20	0.33
88	300130	新国都	132,000	2,196,480.00	0.33
89	300433	蓝思科技	118,100	2,155,325.00	0.32
90	600674	川投能源	113,300	2,124,375.00	0.32
91	300498	温氏股份	106,600	2,112,812.00	0.32
92	601838	成都银行	137,298	2,085,556.62	0.31
93	601108	财通证券	315,423	2,084,946.03	0.31
94	600893	航发动力	56,700	2,072,385.00	0.31
95	002142	宁波银行	93,159	2,055,087.54	0.31
96	601899	紫金矿业	116,700	2,050,419.00	0.31
97	300394	天孚通信	22,840	2,019,512.80	0.30
98	300373	扬杰科技	51,600	2,007,240.00	0.30
99	688012	中微公司	14,200	2,005,892.00	0.30
100	000975	银泰黄金	120,700	1,966,203.00	0.29
101	600585	海螺水泥	81,400	1,920,226.00	0.29

102	601229	上海银行	261,200	1,896,312.00	0.28
103	603288	海天味业	54,832	1,890,059.04	0.28
104	601336	新华保险	62,367	1,872,881.01	0.28
105	002311	海大集团	39,200	1,844,360.00	0.28
106	002252	上海莱士	232,200	1,815,804.00	0.27
107	000999	华润三九	42,430	1,806,669.40	0.27
108	600039	四川路桥	228,000	1,798,920.00	0.27
109	002736	国信证券	205,900	1,789,271.00	0.27
110	600803	新奥股份	86,000	1,788,800.00	0.27
111	300408	三环集团	61,200	1,786,428.00	0.27
112	688188	柏楚电子	9,674	1,785,336.70	0.27
113	601117	中国化学	214,800	1,769,952.00	0.26
114	600919	江苏银行	237,239	1,762,685.77	0.26
115	600018	上港集团	302,900	1,750,762.00	0.26
116	002928	华夏航空	274,500	1,740,330.00	0.26
117	601077	渝农商行	344,400	1,728,888.00	0.26
118	600161	天坛生物	70,600	1,722,640.00	0.26
119	600933	爱柯迪	116,000	1,715,640.00	0.26
120	002466	天齐锂业	57,300	1,713,843.00	0.26
121	300832	新产业	25,400	1,712,976.00	0.26
122	002180	纳思达	64,100	1,693,522.00	0.25
123	601231	环旭电子	104,200	1,672,410.00	0.25
124	601607	上海医药	86,800	1,658,748.00	0.25
125	600547	山东黄金	60,400	1,653,752.00	0.25
126	600426	华鲁恒升	61,600	1,641,024.00	0.25
127	603606	东方电缆	33,600	1,640,016.00	0.25
128	601888	中国中免	26,200	1,637,238.00	0.24
129	002237	恒邦股份	141,500	1,628,665.00	0.24
130	600522	中天科技	101,200	1,604,020.00	0.24
131	000596	古井贡酒	7,500	1,583,025.00	0.24
132	001965	招商公路	132,800	1,575,008.00	0.24
133	601865	福莱特	78,300	1,573,830.00	0.24
134	300724	捷佳伟创	29,100	1,571,691.00	0.24
135	600348	华阳股份	157,700	1,570,692.00	0.24
136	002353	杰瑞股份	44,700	1,568,076.00	0.23
137	002152	广电运通	149,500	1,563,770.00	0.23
138	300002	神州泰岳	190,900	1,550,108.00	0.23
139	603195	公牛集团	19,995	1,542,014.40	0.23
140	000538	云南白药	29,920	1,530,408.00	0.23
141	002384	东山精密	73,800	1,527,660.00	0.23
142	000408	藏格矿业	63,100	1,518,817.00	0.23
143	001979	招商蛇口	171,400	1,506,606.00	0.23
144	300751	迈为股份	12,600	1,505,448.00	0.23

145	600916	中国黄金	156,000	1,500,720.00	0.22
146	600066	宇通客车	57,700	1,488,660.00	0.22
147	688072	拓荆科技	12,372	1,486,000.92	0.22
148	601808	中海油服	83,700	1,439,640.00	0.22
149	000661	长春高新	15,523	1,424,545.71	0.21
150	601990	南京证券	184,093	1,413,834.24	0.21
151	600848	上海临港	152,800	1,392,008.00	0.21
152	000758	中色股份	271,600	1,379,728.00	0.21
153	600233	圆通速递	87,200	1,364,680.00	0.20
154	600941	中国移动	12,500	1,343,750.00	0.20
155	002415	海康威视	43,286	1,337,970.26	0.20
156	002831	裕同科技	51,800	1,325,562.00	0.20
157	605111	新洁能	43,080	1,317,817.20	0.20
158	601216	君正集团	353,900	1,305,891.00	0.20
159	600377	宁沪高速	103,600	1,305,360.00	0.20
160	600096	云天化	67,000	1,301,140.00	0.19
161	002179	中航光电	34,100	1,297,505.00	0.19
162	600025	华能水电	120,300	1,296,834.00	0.19
163	601006	大秦铁路	181,100	1,296,676.00	0.19
164	600183	生益科技	61,200	1,288,872.00	0.19
165	600901	江苏金租	254,640	1,285,932.00	0.19
166	002635	安洁科技	82,600	1,275,344.00	0.19
167	600760	中航沈飞	31,800	1,275,180.00	0.19
168	601958	金钼股份	122,100	1,271,061.00	0.19
169	300274	阳光电源	20,360	1,262,930.80	0.19
170	605090	九丰能源	43,100	1,249,900.00	0.19
171	601298	青岛港	129,800	1,240,888.00	0.19
172	601975	招商南油	344,400	1,236,396.00	0.19
173	002139	拓邦股份	115,677	1,228,489.74	0.18
174	600732	爱旭股份	135,100	1,222,655.00	0.18
175	600323	瀚蓝环境	58,500	1,222,650.00	0.18
176	000712	锦龙股份	162,200	1,216,500.00	0.18
177	603727	博迈科	92,100	1,212,036.00	0.18
178	688981	中芯国际	26,200	1,207,820.00	0.18
179	002120	韵达股份	155,400	1,202,796.00	0.18
180	600395	盘江股份	199,900	1,201,399.00	0.18
181	600663	陆家嘴	134,600	1,187,172.00	0.18
182	002223	鱼跃医疗	31,300	1,176,880.00	0.18
183	002138	顺络电子	42,400	1,164,304.00	0.17
184	300207	欣旺达	76,500	1,160,505.00	0.17
185	601088	中国神华	26,100	1,158,057.00	0.17
186	601066	中信建投	59,600	1,146,704.00	0.17
187	300142	沃森生物	100,700	1,145,966.00	0.17

188	688111	金山办公	4,980	1,132,950.00	0.17
189	300679	电连技术	27,900	1,122,417.00	0.17
190	000550	江铃汽车	51,200	1,111,552.00	0.17
191	002563	森马服饰	188,400	1,094,604.00	0.16
192	000567	海德股份	190,791	1,070,337.51	0.16
193	600559	老白干酒	58,300	1,059,894.00	0.16
194	603198	迎驾贡酒	18,200	1,046,500.00	0.16
195	002192	融捷股份	33,800	1,014,676.00	0.15
196	600548	深高速	95,250	1,012,507.50	0.15
197	300212	易华录	57,900	974,457.00	0.15
198	600048	保利发展	109,400	958,344.00	0.14
199	300379	东方通	117,400	948,592.00	0.14
200	002683	广东宏大	47,000	946,110.00	0.14
201	601019	山东出版	80,000	945,600.00	0.14
202	600398	海澜之家	100,800	931,392.00	0.14
203	603806	福斯特	62,200	914,340.00	0.14
204	002064	华峰化学	126,000	903,420.00	0.14
205	002558	巨人网络	92,400	872,256.00	0.13
206	601528	瑞丰银行	184,600	871,312.00	0.13
207	002833	弘亚数控	47,500	866,400.00	0.13
208	688120	华海清科	4,447	843,062.26	0.13
209	300124	汇川技术	16,079	824,852.70	0.12
210	605589	圣泉集团	39,800	807,542.00	0.12
211	002351	漫步者	60,300	792,945.00	0.12
212	600483	福能股份	67,000	781,220.00	0.12
213	000600	建投能源	119,900	755,370.00	0.11
214	002106	莱宝高科	67,900	740,110.00	0.11
215	603369	今世缘	15,800	729,960.00	0.11
216	603816	顾家家居	22,000	710,380.00	0.11
217	601886	江河集团	145,400	709,552.00	0.11
218	300366	创意信息	96,200	696,488.00	0.10
219	603296	华勤技术	12,500	690,375.00	0.10
220	300059	东方财富	65,300	689,568.00	0.10
221	301238	瑞泰新材	45,300	678,141.00	0.10
222	002997	瑞鹄模具	20,800	664,976.00	0.10
223	000027	深圳能源	90,800	662,840.00	0.10
224	000958	电投产融	175,200	641,232.00	0.10
225	300638	广和通	36,500	624,150.00	0.09
226	002487	大金重工	27,000	617,760.00	0.09
227	000002	万科 A	87,352	605,349.36	0.09
228	600329	达仁堂	18,600	602,454.00	0.09
229	603893	瑞芯微	10,000	591,700.00	0.09
230	002938	鹏鼎控股	14,600	580,496.00	0.09

231	002240	盛新锂能	39,200	526,064.00	0.08
232	300037	新宙邦	17,700	505,512.00	0.08
233	002540	亚太科技	95,500	505,195.00	0.08
234	600236	桂冠电力	63,600	487,812.00	0.07
235	300298	三诺生物	18,200	461,188.00	0.07
236	002706	良信股份	65,400	448,644.00	0.07
237	301268	铭利达	28,200	438,510.00	0.07
238	688372	伟测科技	10,500	412,965.00	0.06
239	688187	时代电气	8,200	404,916.00	0.06
240	300866	安克创新	5,650	402,336.50	0.06
241	601818	光大银行	125,700	398,469.00	0.06
242	601872	招商轮船	46,300	391,235.00	0.06
243	600862	中航高科	19,800	371,844.00	0.06
244	688518	联赢激光	22,000	367,400.00	0.05
245	002008	大族激光	17,100	355,680.00	0.05
246	000728	国元证券	57,700	349,662.00	0.05
247	603960	克来机电	16,100	339,710.00	0.05
248	600015	华夏银行	51,000	326,400.00	0.05
249	688371	菲沃泰	32,500	326,300.00	0.05
250	601138	工业富联	11,900	326,060.00	0.05
251	601169	北京银行	53,995	315,330.80	0.05
252	600372	中航机载	25,400	304,038.00	0.05
253	002727	一心堂	18,800	283,692.00	0.04
254	002714	牧原股份	6,500	283,400.00	0.04
255	603392	万泰生物	4,300	283,284.00	0.04
256	002276	万马股份	38,200	273,894.00	0.04
257	603123	翠微股份	45,400	269,676.00	0.04
258	600415	小商品城	36,000	267,120.00	0.04
259	603132	金徽股份	19,300	265,568.00	0.04
260	600176	中国巨石	23,900	264,095.00	0.04
261	688041	海光信息	3,700	260,184.00	0.04
262	601985	中国核电	24,200	257,972.00	0.04
263	601988	中国银行	53,000	244,860.00	0.04
264	601233	桐昆股份	15,300	244,188.00	0.04
265	600028	中国石化	38,400	242,688.00	0.04
266	600598	北大荒	19,000	237,310.00	0.04
267	600536	中国软件	7,702	230,443.84	0.03
268	688082	盛美上海	2,700	228,177.00	0.03
269	603323	苏农银行	45,900	220,779.00	0.03
270	601390	中国中铁	33,699	219,717.48	0.03
271	600104	上汽集团	15,744	218,211.84	0.03
272	688033	天宜上佳	35,000	210,000.00	0.03
273	603203	快克智能	8,700	205,146.00	0.03

274	002304	洋河股份	2,500	201,850.00	0.03
275	601288	农业银行	44,700	194,892.00	0.03
276	300783	三只松鼠	8,900	194,643.00	0.03
277	000792	盐湖股份	10,900	190,205.00	0.03
278	600588	用友网络	19,000	190,000.00	0.03
279	000100	TCL 科技	43,800	189,216.00	0.03
280	300384	三联虹普	14,400	188,928.00	0.03
281	000807	云铝股份	13,900	187,789.00	0.03
282	003816	中国广核	40,300	186,589.00	0.03
283	688728	格科微	15,400	186,494.00	0.03
284	600007	中国国贸	8,300	182,268.00	0.03
285	300001	特锐德	9,000	181,080.00	0.03
286	603393	新天然气	5,100	177,174.00	0.03
287	601319	中国人保	31,900	164,285.00	0.02
288	601919	中远海控	10,500	162,645.00	0.02
289	601898	中煤能源	13,000	162,240.00	0.02
290	002601	龙佰集团	8,600	159,702.00	0.02
291	600875	东方电气	8,600	158,670.00	0.02
292	600362	江西铜业	6,700	158,656.00	0.02
293	002920	德赛西威	1,800	156,762.00	0.02
294	002078	太阳纸业	11,100	154,845.00	0.02
295	002460	赣锋锂业	5,400	154,710.00	0.02
296	300308	中际旭创	1,120	154,425.60	0.02
297	000786	北新建材	5,200	154,232.00	0.02
298	002028	思源电气	2,300	153,870.00	0.02
299	002625	光启技术	8,600	149,210.00	0.02
300	300661	圣邦股份	1,800	149,004.00	0.02
301	002456	欧菲光	18,700	146,047.00	0.02
302	002129	TCL 中环	16,800	145,320.00	0.02
303	002185	华天科技	17,800	145,070.00	0.02
304	688126	沪硅产业	10,500	145,005.00	0.02
305	600570	恒生电子	8,200	144,812.00	0.02
306	603568	伟明环保	7,000	144,060.00	0.02
307	000423	东阿阿胶	2,300	143,980.00	0.02
308	002493	荣盛石化	14,800	142,968.00	0.02
309	605116	奥锐特	5,700	142,671.00	0.02
310	300765	新诺威	5,600	141,288.00	0.02
311	002595	豪迈科技	3,700	141,229.00	0.02
312	603345	安井食品	1,900	141,189.00	0.02
313	600352	浙江龙盛	16,400	140,876.00	0.02
314	300957	贝泰妮	2,900	140,128.00	0.02
315	603000	人民网	7,000	139,930.00	0.02
316	688777	中控技术	3,700	139,490.00	0.02

317	002812	恩捷股份	4,400	139,260.00	0.02
318	600583	海油工程	23,400	138,294.00	0.02
319	603156	养元饮品	6,500	138,255.00	0.02
320	002603	以岭药业	9,000	137,970.00	0.02
321	600546	山煤国际	9,400	137,428.00	0.02
322	002738	中矿资源	5,100	136,680.00	0.02
323	688099	晶晨股份	2,300	136,436.00	0.02
324	300454	深信服	2,700	136,431.00	0.02
325	600549	厦门钨业	7,900	136,275.00	0.02
326	603596	伯特利	3,500	136,150.00	0.02
327	600511	国药股份	4,400	135,476.00	0.02
328	600699	均胜电子	9,100	134,862.00	0.02
329	600673	东阳光	19,000	133,760.00	0.02
330	603589	口子窖	3,400	133,246.00	0.02
331	000883	湖北能源	22,000	132,220.00	0.02
332	000029	深深房 A	12,400	131,812.00	0.02
333	600779	水井坊	3,500	131,705.00	0.02
334	002821	凯莱英	2,000	131,600.00	0.02
335	603882	金域医学	4,800	130,512.00	0.02
336	002032	苏泊尔	2,600	130,260.00	0.02
337	601800	中国交建	14,500	129,630.00	0.02
338	600872	中炬高新	5,700	129,333.00	0.02
339	000921	海信家电	4,000	128,960.00	0.02
340	603728	鸣志电器	3,200	128,736.00	0.02
341	600380	健康元	11,500	128,455.00	0.02
342	001213	中铁特货	32,500	128,375.00	0.02
343	601018	宁波港	37,600	127,840.00	0.02
344	603688	石英股份	4,300	127,323.00	0.02
345	600299	安迪苏	13,000	126,100.00	0.02
346	002773	康弘药业	5,800	125,570.00	0.02
347	300763	锦浪科技	3,000	124,920.00	0.02
348	600702	舍得酒业	2,200	124,674.00	0.02
349	000935	四川双马	10,300	123,703.00	0.02
350	601568	北元集团	32,400	120,204.00	0.02
351	688095	福昕软件	2,600	119,106.00	0.02
352	688798	艾为电子	2,100	118,902.00	0.02
353	002517	恺英网络	12,000	114,600.00	0.02
354	600515	海南机场	35,700	112,098.00	0.02
355	002648	卫星化学	6,200	111,476.00	0.02
356	600707	彩虹股份	16,200	110,322.00	0.02
357	002465	海格通信	10,500	108,780.00	0.02
358	601101	昊华能源	11,800	108,442.00	0.02
359	600925	苏能股份	21,100	106,555.00	0.02

360	600703	三安光电	9,000	105,480.00	0.02
361	003029	吉大正元	5,800	103,182.00	0.02
362	688176	亚虹医药	19,958	101,985.38	0.02
363	600600	青岛啤酒	1,400	101,878.00	0.02
364	600026	中远海能	6,400	99,904.00	0.01
365	688018	乐鑫科技	1,000	98,680.00	0.01
366	000708	中信特钢	7,200	97,704.00	0.01
367	300017	网宿科技	12,300	97,170.00	0.01
368	000612	焦作万方	14,600	94,900.00	0.01
369	601636	旗滨集团	14,500	93,525.00	0.01
370	603658	安图生物	2,000	92,140.00	0.01
371	002320	海峡股份	17,700	91,332.00	0.01
372	688516	奥特维	2,180	91,145.80	0.01
373	002534	西子洁能	8,700	87,087.00	0.01
374	603565	中谷物流	9,900	86,526.00	0.01
375	600023	浙能电力	12,042	85,618.62	0.01
376	600282	南钢股份	17,100	85,158.00	0.01
377	300133	华策影视	13,100	80,434.00	0.01
378	002241	歌尔股份	4,100	79,991.00	0.01
379	600529	山东药玻	3,000	76,020.00	0.01
380	300253	卫宁健康	12,800	75,520.00	0.01
381	002053	云南能投	6,100	73,749.00	0.01
382	688233	神工股份	3,500	67,445.00	0.01
383	601998	中信银行	8,900	59,630.00	0.01
384	603515	欧普照明	3,400	58,956.00	0.01
385	688153	唯捷创芯	1,400	51,800.00	0.01
386	600458	时代新材	5,100	51,510.00	0.01
387	600662	外服控股	12,100	48,521.00	0.01
388	600158	中体产业	6,000	46,140.00	0.01
389	300316	晶盛机电	1,600	45,968.00	0.01
390	688063	派能科技	1,120	44,475.20	0.01
391	002318	久立特材	1,900	44,327.00	0.01
392	603297	永新光学	700	42,343.00	0.01
393	600718	东软集团	4,900	40,523.00	0.01
394	000636	风华高科	3,100	40,486.00	0.01
395	600095	湘财股份	6,700	39,932.00	0.01
396	603489	八方股份	1,400	37,772.00	0.01
397	601186	中国铁建	4,000	34,280.00	0.01
398	300054	鼎龙股份	1,400	31,752.00	0.00
399	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
400	601369	陕鼓动力	3,700	29,674.00	0.00
401	601609	金田股份	5,100	28,866.00	0.00
402	688088	虹软科技	1,000	28,860.00	0.00

403	688787	海天瑞声	500	27,440.00	0.00
404	000050	深天马 A	3,700	26,936.00	0.00
405	601857	中国石油	2,600	26,832.00	0.00
406	688220	翱捷科技	700	26,222.00	0.00
407	002153	石基信息	4,500	25,785.00	0.00
408	600623	华谊集团	4,300	24,854.00	0.00
409	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
410	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
411	605499	东鹏饮料	100	21,575.00	0.00
412	603008	喜临门	1,200	20,796.00	0.00
413	600436	片仔癀	100	20,717.00	0.00
414	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
415	688366	昊海生科	280	17,270.40	0.00
416	000951	中国重汽	1,200	17,184.00	0.00
417	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
418	002850	科达利	200	15,276.00	0.00
419	603533	掌阅科技	800	14,936.00	0.00
420	002516	旷达科技	4,100	14,924.00	0.00
421	600639	浦东金桥	1,400	14,294.00	0.00
422	603317	天味食品	1,200	13,692.00	0.00
423	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
424	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
425	002158	汉钟精机	800	13,376.00	0.00
426	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
427	300003	乐普医疗	800	11,872.00	0.00
428	002544	普天科技	600	11,214.00	0.00
429	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
430	000001	平安银行	1,100	11,165.00	0.00
431	603605	珀莱雅	100	11,099.00	0.00
432	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
433	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
434	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
435	000800	一汽解放	1,100	8,613.00	0.00
436	002803	吉宏股份	700	7,791.00	0.00
437	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
438	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
439	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
440	002958	青农商行	2,600	6,968.00	0.00
441	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
442	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
443	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
444	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
445	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00

446	300850	新强联	300	4,506.00	0.00
447	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
448	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
449	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
450	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
451	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
452	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
453	600636	国新文化	400	3,000.00	0.00
454	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
455	600667	太极实业	500	2,855.00	0.00
456	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
457	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
458	600956	新天绿能	300	2,451.00	0.00
459	601827	三峰环境	100	849.00	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	601318	中国平安	11,200,456.00	1.56
2	600030	中信证券	11,137,141.00	1.55
3	601166	兴业银行	10,772,523.00	1.50
4	600276	恒瑞医药	10,768,779.00	1.50
5	603160	汇顶科技	10,413,426.00	1.45
6	300750	宁德时代	10,085,641.00	1.40
7	601601	中国太保	10,070,856.00	1.40
8	002475	立讯精密	9,665,882.00	1.35
9	603993	洛阳钼业	9,397,097.00	1.31
10	601877	正泰电器	9,331,250.00	1.30
11	688036	传音控股	9,245,611.69	1.29
12	603501	韦尔股份	9,150,616.55	1.27
13	601816	京沪高铁	8,823,278.00	1.23
14	600519	贵州茅台	8,595,237.00	1.20
15	600741	华域汽车	8,469,268.00	1.18
16	601668	中国建筑	8,254,277.00	1.15
17	600309	万华化学	8,140,924.00	1.13
18	000625	长安汽车	7,972,397.00	1.11
19	603259	药明康德	7,850,969.00	1.09
20	601666	平煤股份	7,821,466.00	1.09

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	601919	中远海控	13,447,544.00	1.87
2	600309	万华化学	11,013,077.00	1.53
3	603259	药明康德	10,539,141.40	1.47
4	600741	华域汽车	10,348,780.30	1.44
5	600276	恒瑞医药	10,079,202.20	1.40
6	600519	贵州茅台	9,987,106.24	1.39
7	300750	宁德时代	9,691,593.00	1.35
8	601138	工业富联	9,596,970.00	1.34
9	600438	通威股份	9,003,976.00	1.25
10	601939	建设银行	8,991,439.00	1.25
11	002594	比亚迪	8,677,328.00	1.21
12	600901	江苏金租	8,632,797.00	1.20
13	000157	中联重科	8,520,601.00	1.19
14	600115	中国东航	8,501,893.00	1.18
15	603993	洛阳钼业	8,462,581.00	1.18
16	600900	长江电力	8,428,899.00	1.17
17	601328	交通银行	8,383,021.00	1.17
18	600016	民生银行	8,223,856.00	1.15
19	688036	传音控股	8,094,261.59	1.13
20	000338	潍柴动力	8,077,650.00	1.12

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	1,512,329,119.48
卖出股票收入（成交）总额	1,563,630,712.24

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他相关的衍生工具。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

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

7.12.2 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	68,606.98
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	54,816.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	123,423.86

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 (%)
173,939	2,181.58	20,914,824.11	5.51	358,547,078.18	94.49

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	346,684.72	0.091362

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	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门 负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2016 年 7 月 13 日) 基金份额总额	219,324,726.66
本报告期期初基金份额总额	409,612,919.42
本报告期基金总申购份额	8,946,890.81
减：本报告期基金总赎回份额	39,097,907.94
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	379,461,902.29

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

本基金本报告期末未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中邮证券股份有限公司	1	344,260,921.43	11.20	325,635.89	11.20	未变更
东方证券股份有限公司	3	226,500,077.39	7.37	214,255.67	7.37	未变更
中信证券股份有限公司	3	215,967,438.16	7.02	204,281.07	7.02	未变更
国海证券股份有限公司	1	211,301,859.44	6.87	199,873.67	6.87	未变更

公司						
申万宏源 证券有限 公司	1	209,669,803.24	6.82	198,317.30	6.82	未变更
民生证券 股份有限 公司	1	205,907,498.43	6.70	194,774.39	6.70	未变更
国投证券 股份有限 公司	1	174,998,336.90	5.69	165,531.55	5.69	未变更
广发证券 股份有限 公司	2	164,339,073.55	5.35	155,450.30	5.35	未变更
中国国际 金融股份 有限公司	2	162,312,340.63	5.28	153,533.00	5.28	未变更
方正证券 股份有限 公司	2	137,347,432.44	4.47	129,915.80	4.47	未变更
国金证券 股份有限 公司	1	133,713,973.98	4.35	126,474.34	4.35	未变更
华创证券 有限责任 公司	1	129,461,983.26	4.21	122,459.96	4.21	未变更
天风证券 股份有限 公司	1	108,976,812.26	3.54	103,080.60	3.54	未变更
中泰证券 股份有限 公司	1	102,796,365.01	3.34	97,235.81	3.34	未变更
长城证券 股份有限 公司	1	102,605,518.40	3.34	97,054.42	3.34	未变更
开源证券 股份有限 公司	2	97,373,730.83	3.17	92,107.01	3.17	未变更
华西证券 股份有限 公司	1	74,033,765.43	2.41	70,026.20	2.41	未变更
中银国际 证券股份 有限公司	1	68,361,897.36	2.22	64,663.03	2.22	未变更
瑞银证券	1	67,137,073.16	2.18	63,505.74	2.18	未变更

有限责任公司						
海通证券股份有限公司	1	51,191,625.35	1.67	48,423.10	1.67	未变更
光大证券股份有限公司	2	46,632,440.90	1.52	44,106.22	1.52	未变更
国盛证券有限责任公司	1	36,731,168.77	1.19	34,745.04	1.19	未变更
中国银河证券股份有限公司	1	1,820,950.86	0.06	1,722.73	0.06	未变更
兴业证券股份有限公司	1	1,097,084.00	0.04	1,037.66	0.04	未变更
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
东亚前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
高盛(中国)证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
国都证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
瑞信证券(中国)有	2	-	-	-	-	未变更

限公司						
太平洋证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
招商证券股份有限公司	4	-	-	-	-	未变更
中航证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中邮证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国投资券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
高盛(中国)证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞信证券(中国)有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月10日
2	景顺长城基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月19日
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2023年第4季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月22日
4	景顺长城量化新动力股票型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月22日
5	景顺长城基金管理有限公司关于终止华融融达期货股份有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年2月8日
6	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月22日
7	关于警惕假冒景顺长城基金APP开展诈骗活动的声明	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月27日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2023年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月29日
9	景顺长城量化新动力股票型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月29日
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月13日
11	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月15日
12	景顺长城量化新动力股票型证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月22日
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2024年第1季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月22日
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2024年5月24日

	停机维护的公告	网站	
15	景顺长城量化新动力股票型证券投资基金 2024 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 25 日
16	景顺长城量化新动力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	2024 年 5 月 25 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	2024 年 5 月 31 日
18	景顺长城量化新动力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	2024 年 6 月 14 日
19	景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 21 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城量化新动力股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城量化新动力股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城量化新动力股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城量化新动力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

2024 年 8 月 30 日