

景顺长城安瑞混合型证券投资基金 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 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 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 7 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 3.3 其他指标 | 9 |
| § 4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 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 | 11 |
| 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 | 13 |
| 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 | 13 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 13 |
| 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 | 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 净资产变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 38 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 38 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 39 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 41 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 42 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 42 |
| 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 | 42 |
| 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 | 43 |
| 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 | 43 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 43 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 43 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 43 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 45 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 46 |
| 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 | 46 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 46 |
| § 10 重大事件揭示 | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 46 |
| 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 | 46 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 47 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 47 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 47 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 47 |
| 10.8 其他重大事件 | 48 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 50 |
| 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 | 50 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 50 |
| § 12 备查文件目录 | 50 |
| 12.1 备查文件目录 | 50 |
| 12.2 存放地点 | 50 |
| 12.3 查阅方式 | 50 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 基金名称 | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 景顺长城安瑞混合 | |
| 基金主代码 | 012137 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2022 年 9 月 23 日 | |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 76,788,436.98 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 景顺长城安瑞混合 A | 景顺长城安瑞混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012137 | 014926 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 37,586,209.38 份 | 39,202,227.60 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于固定收益类资产获得稳健收益，同时投资于具备良好盈利能力的上市公司所发行的股票以增强收益，在严格控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，重点关注包括、GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析和充分论证的基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用债投资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>3、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、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>4、股票投资策略</p> <p>本基金以基本面为核心，确定行业配置方向，并结合宏观政策、情绪与技术面指标，在风险可控的范围内积极进行战术性仓位管理，使得风险收益比最大化。</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>5、股指期货投资策略 本基金参与股指期货交易，将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>6、国债期货投资策略 本基金可基于谨慎原则，将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。</p> <p>7、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>8、信用衍生品投资策略 本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。</p> <p>9、融资策略 本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证综合债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率*15%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5% |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。</p> <p>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> |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|------------------------------|----------------------------|
| 名称 | | 景顺长城基金管理有限公司 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 杨皞阳 | 龚小武 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 | 021-52629999-212056 |
| | 电子邮箱 | investor@igwfm.com | gongxiaowu@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008888606 | 95561 |
| 传真 | | 0755-22381339 | 021-62159217 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼 |
| 邮政编码 | | 518048 | 200120 |
| 法定代表人 | | 李进 | 吕家进 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.igwfm.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------|------------------------------|
| 注册登记机构 | 景顺长城基金管理有限公司 | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) | |
|---------------|-------------------------------------|---------------|
| | 景顺长城安瑞混合 A | 景顺长城安瑞混合 C |
| 本期已实现收益 | 1,006,576.63 | 938,230.28 |
| 本期利润 | 3,957,988.97 | 3,050,184.60 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0803 | 0.0750 |
| 本期加权平均净值利润率 | 7.66% | 7.16% |
| 本期基金份额净值增长率 | 7.97% | 7.74% |
| 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 | 2,326,218.03 | 2,131,117.05 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0619 | 0.0544 |
| 期末基金资产净值 | 41,081,871.97 | 42,546,122.85 |
| 期末基金份额净值 | 1.0930 | 1.0852 |
| 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 | 9.30% | 8.52% |

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四位，小数点后第五位舍去，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

景顺长城安瑞混合 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④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -1.93% | 0.49% | 0.13% | 0.10% | -2.06% | 0.39% |

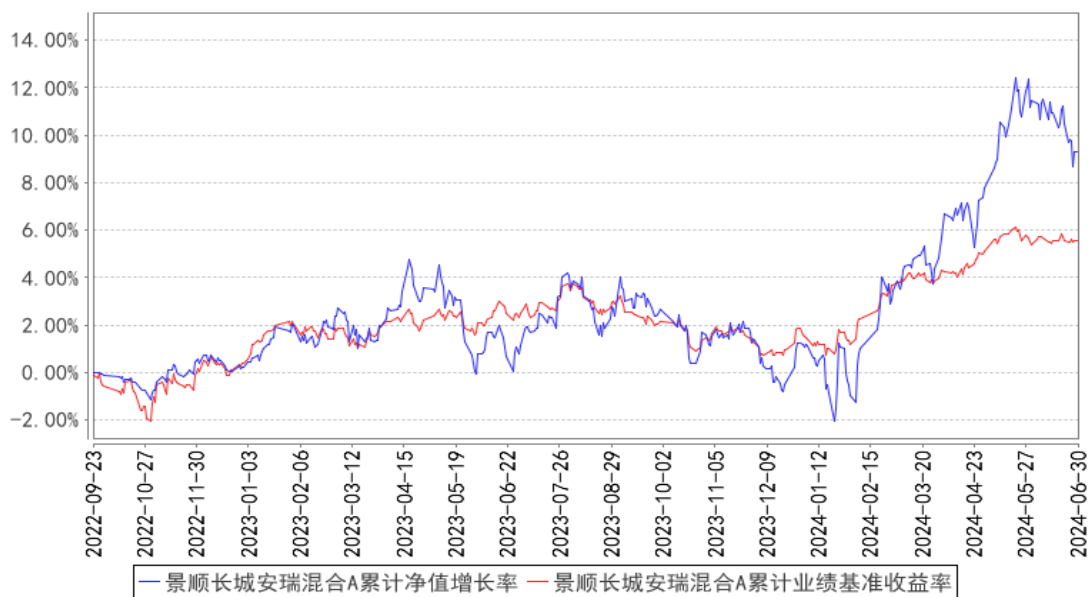
| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 过去三个月 | 4.27% | 0.55% | 1.49% | 0.15% | 2.78% | 0.40% |
| 过去六个月 | 7.97% | 0.55% | 3.58% | 0.18% | 4.39% | 0.37% |
| 过去一年 | 8.06% | 0.48% | 2.97% | 0.18% | 5.09% | 0.30% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.30% | 0.41% | 5.54% | 0.20% | 3.76% | 0.21% |

景顺长城安瑞混合 C

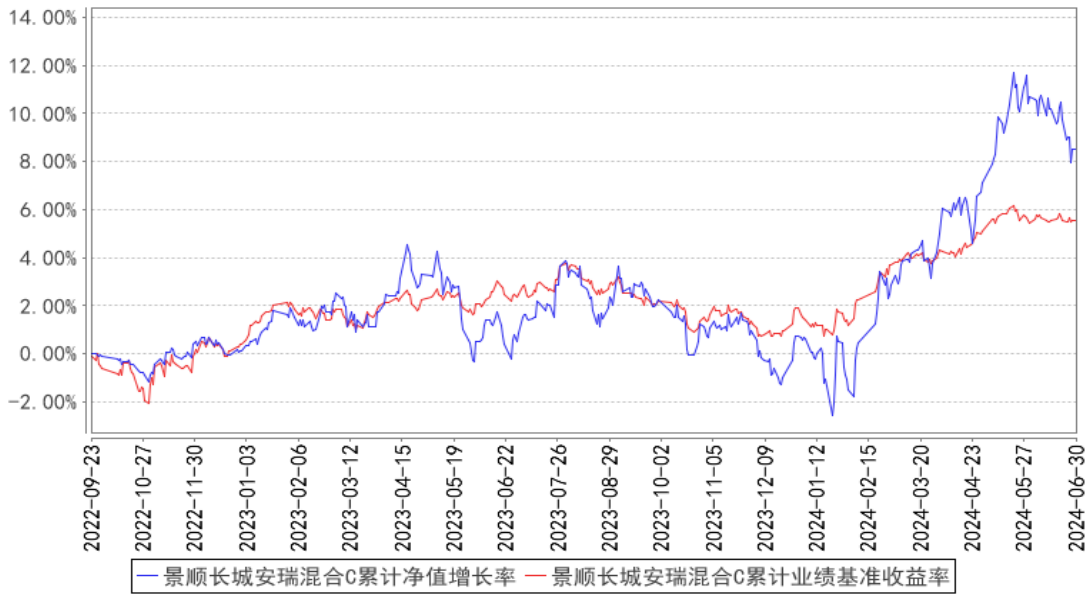
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -1.97% | 0.49% | 0.13% | 0.10% | -2.10% | 0.39% |
| 过去三个月 | 4.17% | 0.55% | 1.49% | 0.15% | 2.68% | 0.40% |
| 过去六个月 | 7.74% | 0.55% | 3.58% | 0.18% | 4.16% | 0.37% |
| 过去一年 | 7.62% | 0.47% | 2.97% | 0.18% | 4.65% | 0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.52% | 0.41% | 5.54% | 0.20% | 2.98% | 0.21% |

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

景顺长城安瑞混合A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



景顺长城安瑞混合C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：基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-40%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；投资于同业存单比例不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2022 年 9 月 23 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 | | |
| 李怡文 | 本基金的基金经理 | 2022年9月23日 | - | 18年 | 工商管理硕士。曾任国家外汇管理局会计处组合分析师，佛罗里瑞伟投资管理公司研究员，中国建设银行香港组合管理经理，国投瑞银基金管理有限公司固定收益部副总监、基金经理。2020年4月加入本公司，担任固定收益部稳定收益业务投资负责人，自2021年4月起担任固定收益部基金经理，现任混合资产投资部总经理、基金经理。具有18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、《景顺长城安瑞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 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

今年以来，我国经济总体仍在曲折修复的过程中，在一季度实现了较为强劲的开局之后，二季度边际有所走弱。具体看来，制造业 PMI 在 1~2 月处于荣枯线以下低位震荡后，3~4 月分别录得 50.8 和 50.4，5~6 月又回落至荣枯线以下。消费延续温和修复，但在结构性产能过剩的背景下，总体价格仍面临一定压力；固定资产投资韧性较强，主要是制造业投资延续亮眼表现，地产投资仍在回落通道中，基建投资逐月下滑；出口受益于全球制造业复苏而较为强劲。海外方面，在韧性较强的增长数据和回落节奏较慢的通胀数据影响下，美联储降息指引波动较大，市场对联储降息预期大幅后移。市场表现方面，上半年债券表现最好，其次是转债，再者是股票。债券收益率震荡下行，长端表现突出，30 年国债收益率今年以来创出历史新低后保持低位震荡；股市走势整体跟随经济修复节奏，今年一季度遭遇流动性冲击后，上证指数重新站上 3000 点，二季度走势整体震荡；转债则在相对较高的债底保护下，调整幅度总体小于股票。操作方面，债券久期总体保持在中性左右的水平，信用债逢高配置 1~3 年高等级；转债方面，我们在 2 月份市场受到冲击的情况下，适度增加了转债资产的配置，标的仍然以正股和转债估值稳健的个券为主；股票方面，基本维持中高仓位，继续超配上游的能源和有色板块，同时适度均衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年上半年，景顺长城安瑞混合 A 类份额净值增长率为 7.97%，业绩比较基准收益率为 3.58%；

2024 年上半年，景顺长城安瑞混合 C 类份额净值增长率为 7.74%，业绩比较基准收益率为 3.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为经济总体仍在回归潜在增长中枢的过程中，下半年会环比改善。首先，投资有望发力，预计专项债发行会明显提速，并带动银行配套信贷投放，形成实物工作量，进而带动物价温和回升；地产投资方面，“607”国常会提出“继续研究储备新的去库存、稳市场政策措施”，稳地产政策有望持续出台。此外，国务院发布的《推动大规模设备更新和消费品以旧换新

行动方案》等支持性政策有望带动设备投资延续高增速。其次，消费意愿提升有望带动消费向上修复。尽管前期房价环比的加速下行对居民的消费意愿有所抑制，但后续随着财政力度的边际扩大，居民就业和收入有望边际改善，进而带动消费修复；再者，出口在海外库存周期回升和新兴市场需求改善的背景下有望保持平稳。海外方面，美联储 6 月 FOMC 决议将基准利率维持在 5.25%-5.5%，点阵图将 2024 年降息次数从 3 次下调至 1 次。美国经济数据总体保持高韧性但也有边际走弱的迹象出现，6 月偏弱的 CPI 数据有助于增强对通胀回到 2% 的信心。

操作方面，债券部分预期保持中性久期，会加大操作的灵活度；转债方面自下而上关注溢价率合理标的的布局机会；股票方面会继续保持合同约定中高仓位，关注具有核心竞争力且景气程度有望改善的高端制造业以及内需逐步企稳后带来的投资机会。

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

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城安瑞混合型证券投资基金

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 | 2,425,954.27 | 1,168,781.81 |
| 结算备付金 | | 1,182,495.76 | 480,089.83 |
| 存出保证金 | | 8,875.20 | 14,492.86 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 75,036,741.82 | 129,962,576.23 |
| 其中：股票投资 | | 32,338,769.61 | 46,363,370.33 |
| 基金投资 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 债券投资 | | 42,697,972.21 | 83,599,205.90 |
| 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 | 53,402.73 | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 6,012,312.97 | 10,001,510.70 |
| 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 | | 1,078,248.99 | 5,262,280.17 |
| 应收股利 | | 133,607.75 | 10,880.00 |
| 应收申购款 | | 7,211.72 | 1,310.10 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 85,938,851.21 | 146,901,921.70 |
| 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 | | - | 21,111,888.09 |
| 应付清算款 | | 1,252,067.50 | 6,026,494.22 |
| 应付赎回款 | | 859,407.38 | 2,279,168.63 |
| 应付管理人报酬 | | 55,245.42 | 80,508.65 |
| 应付托管费 | | 13,811.33 | 20,127.16 |
| 应付销售服务费 | | 13,910.23 | 17,053.06 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 1,170.55 | 1,391.47 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 115,243.98 | 216,267.22 |
| 负债合计 | | 2,310,856.39 | 29,752,898.50 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 76,788,436.98 | 115,965,664.34 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 6,839,557.84 | 1,183,358.86 |
| 净资产合计 | | 83,627,994.82 | 117,149,023.20 |
| 负债和净资产总计 | | 85,938,851.21 | 146,901,921.70 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 76,788,436.98 份，其中本基金 A 类份额净值

人民币 1.0930 元，基金份额 37,586,209.38 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.0852 元，基金份额 39,202,227.60 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城安瑞混合型证券投资基金

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 | | 7,695,122.30 | 6,618,044.97 |
| 1. 利息收入 | | 57,240.39 | 175,108.01 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 16,488.85 | 19,254.53 |
| 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 | | 40,751.54 | 155,853.48 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 2,567,453.37 | 6,755,270.54 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | 641,594.77 | 2,391,471.40 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 1,307,425.11 | 2,657,149.05 |
| 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 | 160,293.47 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 458,140.02 | 1,706,650.09 |
| 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 | 5,063,366.66 | -460,701.46 |
| 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 | 7,061.88 | 148,367.88 |
| 减：二、营业总支出 | | 686,948.73 | 1,555,267.14 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 375,548.47 | 984,826.26 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 93,887.10 | 246,206.56 |

| | | | |
|---------------------|------------|--------------|--------------|
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 84,784.54 | 123,925.74 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 18,835.46 | 82,566.80 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 18,835.46 | 82,566.80 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 1,651.60 | 1,173.08 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 112,241.56 | 116,568.70 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 7,008,173.57 | 5,062,777.83 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 7,008,173.57 | 5,062,777.83 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 7,008,173.57 | 5,062,777.83 |

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城安瑞混合型证券投资基金

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 | 115,965,664.34 | - | 1,183,358.86 | 117,149,023.20 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 115,965,664.34 | - | 1,183,358.86 | 117,149,023.20 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -39,177,227.36 | - | 5,656,198.98 | -33,521,028.38 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 7,008,173.57 | 7,008,173.57 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以 | -39,177,227.36 | - | -1,351,974.59 | -40,529,201.95 |

| | | | | |
|--|---------------------------------|--------|---------------|-----------------|
| “-”号填列) | | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 12,340,684.08 | - | 1,226,461.69 | 13,567,145.77 |
| 2. 基金赎回款 | -51,517,911.44 | - | -2,578,436.28 | -54,096,347.72 |
| (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 | 76,788,436.98 | - | 6,839,557.84 | 83,627,994.82 |
| 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 | 351,693,981.59 | - | 693,679.58 | 352,387,661.17 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 351,693,981.59 | - | 693,679.58 | 352,387,661.17 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -178,344,713.11 | - | 1,114,691.58 | -177,230,021.53 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 5,062,777.83 | 5,062,777.83 |
| (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) | -178,344,713.11 | - | -3,948,086.25 | -182,292,799.36 |
| 其中：1. 基金申购款 | 27,102,665.04 | - | 566,271.06 | 27,668,936.10 |
| 2. 基金赎回款 | -205,447,378.15 | - | -4,514,357.31 | -209,961,735.46 |

| | | | | |
|--|----------------|---|--------------|----------------|
| (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 | 173,349,268.48 | - | 1,808,371.16 | 175,157,639.64 |

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

景顺长城安瑞混合型证券投资基金(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[2021]4111号《关于准予景顺长城安瑞混合型证券投资基金注册的批复》注册,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城安瑞混合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361,098,924.31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(2022)第0803号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金合同》于2022年9月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为361,230,858.44份基金份额,其中认购资金利息折合131,934.13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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金合同》和《景顺长城安瑞混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取前端认购费/申购费用,且不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购费/申购费用,而从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类和C类基金份额分别计算基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金

份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债券、公开发行的次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债的纯债部分、可交换债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款等)、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、股票期权、股指期货、国债期货、信用衍生品以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据法律法规的规定参与融资业务。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为 0-40%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%;投资于同业存单比例不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金以后,应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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率 X80%+沪深 300 指数收益率 X15%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)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 | 2,425,954.27 |
| 等于：本金 | 2,425,623.15 |
| 加：应计利息 | 331.12 |
| 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 | 2,425,954.27 |

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 | 30,286,623.95 | - | 32,338,769.61 | 2,052,145.66 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 34,036,915.38 | 363,788.34 | 35,393,158.64 | 992,454.92 |
| | 银行间市场 | 7,117,678.57 | 156,913.57 | 7,304,813.57 | 30,221.43 |
| | 合计 | 41,154,593.95 | 520,701.91 | 42,697,972.21 | 1,022,676.35 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 71,441,217.90 | 520,701.91 | 75,036,741.82 | 3,074,822.01 | |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 | | | 备注 |
|--------|-------------------|-----------|----|----|
| | 合同/名义 金额 | 公允价值 | | |
| | | 资产 | 负债 | |
| 利率衍生工具 | - | - | - | - |
| 货币衍生工具 | - | - | - | - |
| 权益衍生工具 | - | 53,402.73 | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | - | 53,402.73 | - | - |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | 2024 年 6 月 30 日 | |
|-------|-----------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 6,012,312.97 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 6,012,312.97 | - |

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 | 1.29 |
| 应付证券出借违约金 | - |

| | |
|----------|------------|
| 应付交易费用 | 16,435.09 |
| 其中：交易所市场 | 15,615.84 |
| 银行间市场 | 819.25 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 98,807.60 |
| 合计 | 115,243.98 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城安瑞混合 A

| 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 | 67,626,101.51 | 67,626,101.51 |
| 本期申购 | 4,825,338.42 | 4,825,338.42 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -34,865,230.55 | -34,865,230.55 |
| 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 | 37,586,209.38 | 37,586,209.38 |

景顺长城安瑞混合 C

| 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 | 48,339,562.83 | 48,339,562.83 |
| 本期申购 | 7,515,345.66 | 7,515,345.66 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -16,652,680.89 | -16,652,680.89 |
| 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 | 39,202,227.60 | 39,202,227.60 |

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

景顺长城安瑞混合 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------|--------------|---------------|------------|
| 上年度末 | 2,248,844.73 | -1,414,400.78 | 834,443.95 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 2,248,844.73 | -1,414,400.78 | 834,443.95 |
| 本期利润 | 1,006,576.63 | 2,951,412.34 | 3,957,988.97 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -929,203.33 | -367,567.00 | -1,296,770.33 |
| 其中：基金申购款 | 252,131.04 | 259,761.23 | 511,892.27 |
| 基金赎回款 | -1,181,334.37 | -627,328.23 | -1,808,662.60 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,326,218.03 | 1,169,444.56 | 3,495,662.59 |

景顺长城安瑞混合 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|--------------|---------------|--------------|
| 上年度末 | 1,354,743.22 | -1,005,828.31 | 348,914.91 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 1,354,743.22 | -1,005,828.31 | 348,914.91 |
| 本期利润 | 938,230.28 | 2,111,954.32 | 3,050,184.60 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -161,856.45 | 106,652.19 | -55,204.26 |
| 其中：基金申购款 | 330,025.91 | 384,543.51 | 714,569.42 |
| 基金赎回款 | -491,882.36 | -277,891.32 | -769,773.68 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,131,117.05 | 1,212,778.20 | 3,343,895.25 |

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 | 5,513.33 |
| 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 | 10,881.20 |
| 其他 | 94.32 |
| 合计 | 16,488.85 |

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 | 641,594.77 |
| 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 | 641,594.77 |

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 | 29,325,434.02 |
| 减：卖出股票成本总额 | 28,617,330.05 |
| 减：交易费用 | 66,509.20 |
| 买卖股票差价收入 | 641,594.77 |

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 492,954.68 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 814,470.43 |
| 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 | 1,307,425.11 |

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 71,914,623.52 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 70,322,453.12 |
| 减：应计利息总额 | 775,413.77 |
| 减：交易费用 | 2,286.20 |
| 买卖债券差价收入 | 814,470.43 |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 国债期货投资收益 | -79,255.26 |
| 股指期货投资收益 | 239,548.73 |

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 | 458,140.02 |
| 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 | 458,140.02 |

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 | 5,009,963.93 |
| 股票投资 | 3,985,130.61 |
| 债券投资 | 1,024,833.32 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | 53,402.73 |
| 权证投资 | 53,402.73 |
| 3. 其他 | - |

| | |
|------------------------|--------------|
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 5,063,366.66 |

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 | 6,883.39 |
| 基金转换费收入 | 178.49 |
| 合计 | 7,061.88 |

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 | 29,835.26 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 债券托管账户维护费 | 18,900.00 |
| 银行划款手续费 | 3,075.11 |
| 证券组合费 | 741.11 |
| 存托服务费 | 17.74 |
| 合计 | 112,241.56 |

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 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”） | 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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6 月30日 | 上年度可比期间 2023年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 | 375,548.47 | 984,826.26 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 160,566.91 | 470,069.49 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 214,981.56 | 514,756.77 |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.80% / 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 | 93,887.10 | 246,206.56 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

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 2024年1月1日至2024年6月30日 | | |
|----------------|----------------------------|------------|----|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 景顺长城安瑞混合 A | 景顺长城安瑞混合 C | 合计 |
| | | | |

| | | | |
|----------------|----------------------|------------|-----------|
| 景顺长城基金管理有限公司 | - | 196.05 | 196.05 |
| 兴业银行 | - | 34,982.49 | 34,982.49 |
| 长城证券 | - | 539.32 | 539.32 |
| 合计 | - | 35,717.86 | 35,717.86 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 景顺长城安瑞混合 A | 景顺长城安瑞混合 C | 合计 |
| 景顺长城基金管理有限公司 | - | 3,625.86 | 3,625.86 |
| 兴业银行 | - | 65,387.52 | 65,387.52 |
| 长城证券 | - | 2,262.90 | 2,262.90 |
| 合计 | - | 71,276.28 | 71,276.28 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

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 | 上年度可比期间 |
|-------|----------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | 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 |
|---------|--------------|----------|--------------|-----------|
| 兴业银行-活期 | 2,425,954.27 | 5,513.33 | 1,223,353.04 | 13,559.68 |

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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 43.34%（上年度末：62.12%）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中

度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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 | 2,425,954.27 | - | - | - | - | - | 2,425,954.27 |
| 结算备付金 | 1,182,495.76 | - | - | - | - | - | 1,182,495.76 |
| 存出保证金 | 8,875.20 | - | - | - | - | - | 8,875.20 |
| 交易性金融资产 | 4,671,829.32 | - | 1,331,842.22 | 34,773,198.30 | 1,921,102.37 | 32,338,769.61 | 75,036,741.82 |
| 衍生金融资产 | 53,402.73 | - | - | - | - | - | 53,402.73 |
| 买入返售金融资产 | 6,012,312.97 | - | - | - | - | - | 6,012,312.97 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 133,607.75 | 133,607.75 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 7,211.72 | 7,211.72 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 1,078,248.99 | 1,078,248.99 |
| 资产总计 | 14,354,870.25 | - | 1,331,842.22 | 34,773,198.30 | 1,921,102.37 | 33,557,838.07 | 85,938,851.21 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 859,407.38 | 859,407.38 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 55,245.42 | 55,245.42 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 13,811.33 | 13,811.33 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 1,252,067.50 | 1,252,067.50 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 13,910.23 | 13,910.23 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 1,170.55 | 1,170.55 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 115,243.98 | 115,243.98 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 2,310,856.39 | 2,310,856.39 |
| 利率敏感度缺口 | 14,354,870.25 | - | 1,331,842.22 | 34,773,198.30 | 1,921,102.37 | - | - |
| 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 | 1,168,781.81 | - | - | - | - | - | 1,168,781.81 |
| 结算备付金 | 480,089.83 | - | - | - | - | - | 480,089.83 |
| 存出保证金 | 14,492.86 | - | - | - | - | - | 14,492.86 |
| 交易性金融资 | - | - | 8,598,222.16 | 49,198,499.28 | 25,802,484.46 | 46,363,370.33 | 129,962,576.23 |

| | | | | | | | |
|-----------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|--------------|----------------|
| 产 | | | | | | | |
| 买入返售金融资产 | 10,001,510.70 | - | - | - | - | - | 10,001,510.70 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 10,880.00 | 10,880.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 1,310.10 | 1,310.10 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 5,262,280.17 | 5,262,280.17 |
| 资产总计 | 11,664,875.20 | -8,598,222.16 | 49,198,499.28 | 25,802,484.46 | 51,637,840.60 | | 146,901,921.70 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 2,279,168.63 | 2,279,168.63 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 80,508.65 | 80,508.65 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 20,127.16 | 20,127.16 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 6,026,494.22 | 6,026,494.22 |
| 卖出回购金融资产款 | 21,111,888.09 | - | - | - | - | - | 21,111,888.09 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 17,053.06 | 17,053.06 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 1,391.47 | 1,391.47 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 216,267.22 | 216,267.22 |
| 负债总计 | 21,111,888.09 | - | - | - | - | 8,641,010.41 | 29,752,898.50 |
| 利率敏感度缺口 | -9,447,012.89 | -8,598,222.16 | 49,198,499.28 | 25,802,484.46 | | | - |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--------------------|-----------------------------|-----------------------|
| 假设 | 除市场利率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) |
| | 市场利率上升25个基点 | -160,667.32 | -377,296.09 |
| | 市场利率下降25个基点 | 162,963.42 | 382,295.73 |

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 | | | |
|----------|-------------------|--------------|----------------|----|
| | 美元 折合人民币元 | 港币 折合人民币元 | 其他币种 折合人民币元 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |

| | | | | |
|---------------|---------------------|---------------|----------------|---------------|
| 交易性金融资产 | - | 15,674,766.97 | - | 15,674,766.97 |
| 衍生金融资产 | - | 53,402.73 | - | 53,402.73 |
| 资产合计 | - | 15,728,169.70 | - | 15,728,169.70 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 15,728,169.70 | - | 15,728,169.70 |
| 项目 | 上年度末 2023年12月31日 | | | |
| | 美元 折合人民币元 | 港币 折合人民币元 | 其他币种 折合人民币元 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 22,662,279.43 | - | 22,662,279.43 |
| 资产合计 | - | 22,662,279.43 | - | 22,662,279.43 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 22,662,279.43 | - | 22,662,279.43 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| | | | |
|----|-----------------|-----------------------------|-----------------------|
| 假设 | 除汇率外的其他市场变量保持不变 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 （2024年6月30日） | 上年度末 （2023年12月31日） |
| | 所有外币相对人民币升值5% | 783,738.35 | 1,133,113.97 |
| | 所有外币相对人民币贬值5% | -783,738.35 | -1,133,113.97 |

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 | 32,338,769.61 | 38.67 | 46,363,370.33 | 39.58 |

| | | | | |
|---------------|---------------|-------|---------------|-------|
| 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 | 53,402.73 | 0.06 | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 32,392,172.34 | 38.73 | 46,363,370.33 | 39.58 |

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% | 2,078,684.82 | 1,884,984.02 |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -2,078,684.82 | -1,884,984.02 |

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 | 47,794,690.22 | 67,439,709.08 |
| 第二层次 | 27,295,454.33 | 62,522,867.15 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 75,090,144.55 | 129,962,576.23 |

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 | 32,338,769.61 | 37.63 |
| | 其中：股票 | 32,338,769.61 | 37.63 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 42,697,972.21 | 49.68 |
| | 其中：债券 | 42,697,972.21 | 49.68 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | 53,402.73 | 0.06 |
| 6 | 买入返售金融资产 | 6,012,312.97 | 7.00 |
| | 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 | 3,608,450.03 | 4.20 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,227,943.66 | 1.43 |
| 9 | 合计 | 85,938,851.21 | 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 15,674,766.97 元，占基金资产净值的比例为 18.74%。

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 | - | - |
| B | 采矿业 | 6,881,264.00 | 8.23 |
| C | 制造业 | 8,001,153.64 | 9.57 |
| 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 | 261,669.00 | 0.31 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 43,254.00 | 0.05 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 998,544.00 | 1.19 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 478,118.00 | 0.57 |
| 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 | 16,664,002.64 | 19.93 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|---------------|--------------|
| 原材料 | 1,327,255.76 | 1.59 |
| 周期性消费品 | 1,966,807.14 | 2.35 |
| 非周期性消费品 | 777,763.08 | 0.93 |
| 综合 | 77,760.34 | 0.09 |
| 能源 | 8,361,024.97 | 10.00 |
| 金融 | 1,446,473.67 | 1.73 |
| 基金 | - | - |
| 工业 | 1,366,117.67 | 1.63 |
| 信息技术 | 351,564.34 | 0.42 |
| 公用事业 | - | - |
| 通讯 | - | - |
| 合计 | 15,674,766.97 | 18.74 |

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

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 | 01898 | 中煤能源 | 528,000 | 4,394,882.76 | 5.26 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 2 | 00883 | 中国海洋石油 | 194,000 | 3,966,142.21 | 4.74 |
| 3 | 601225 | 陕西煤业 | 132,300 | 3,409,371.00 | 4.08 |
| 4 | 000858 | 五粮液 | 11,400 | 1,459,656.00 | 1.75 |
| 5 | 601899 | 紫金矿业 | 77,300 | 1,358,161.00 | 1.62 |
| 6 | 00525 | 广深铁路股份 | 690,000 | 1,335,068.30 | 1.60 |
| 7 | 01208 | 五矿资源 | 488,000 | 1,327,255.76 | 1.59 |
| 8 | 00753 | 中国国航 | 374,000 | 1,239,072.62 | 1.48 |
| 9 | 600489 | 中金黄金 | 78,600 | 1,163,280.00 | 1.39 |
| 10 | 600961 | 株冶集团 | 113,200 | 1,068,608.00 | 1.28 |
| 11 | 300750 | 宁德时代 | 5,600 | 1,008,168.00 | 1.21 |
| 12 | 001979 | 招商蛇口 | 113,600 | 998,544.00 | 1.19 |
| 13 | 688012 | 中微公司 | 6,759 | 954,776.34 | 1.14 |
| 14 | 00960 | 龙湖集团 | 96,000 | 939,257.24 | 1.12 |
| 15 | 001323 | 慕思股份 | 29,500 | 848,715.00 | 1.01 |
| 16 | 01177 | 中国生物制药 | 311,000 | 757,862.09 | 0.91 |
| 17 | 000933 | 神火股份 | 32,600 | 659,498.00 | 0.79 |
| 18 | 02331 | 李宁 | 42,500 | 655,532.41 | 0.78 |
| 19 | 603259 | 药明康德 | 12,200 | 478,118.00 | 0.57 |
| 20 | 06886 | HTSC | 58,800 | 463,133.99 | 0.55 |
| 21 | 002155 | 湖南黄金 | 24,400 | 441,640.00 | 0.53 |
| 22 | 000768 | 中航西飞 | 14,900 | 358,047.00 | 0.43 |
| 23 | 00981 | 中芯国际 | 22,500 | 351,564.34 | 0.42 |
| 24 | 002050 | 三花智控 | 16,706 | 318,750.48 | 0.38 |
| 25 | 600348 | 华阳股份 | 29,600 | 294,816.00 | 0.35 |
| 26 | 600835 | 上海机电 | 25,100 | 288,901.00 | 0.35 |
| 27 | 600079 | 人福医药 | 14,700 | 252,399.00 | 0.30 |
| 28 | 002120 | 韵达股份 | 22,400 | 173,376.00 | 0.21 |
| 29 | 600519 | 贵州茅台 | 100 | 146,739.00 | 0.18 |
| 30 | 600438 | 通威股份 | 7,100 | 135,681.00 | 0.16 |
| 31 | 688518 | 联赢激光 | 7,980 | 133,266.00 | 0.16 |
| 32 | 688472 | 阿特斯 | 13,049 | 132,838.82 | 0.16 |
| 33 | 000923 | 河钢资源 | 6,400 | 110,208.00 | 0.13 |
| 34 | 600985 | 淮北矿业 | 6,200 | 103,788.00 | 0.12 |
| 35 | 601919 | 中远海控 | 5,700 | 88,293.00 | 0.11 |
| 36 | 600089 | 特变电工 | 5,800 | 80,446.00 | 0.10 |
| 37 | 00267 | 中信股份 | 12,000 | 77,760.34 | 0.09 |
| 38 | 000333 | 美的集团 | 1,200 | 77,400.00 | 0.09 |
| 39 | 002709 | 天赐材料 | 4,400 | 77,264.00 | 0.09 |
| 40 | 00175 | 吉利汽车 | 9,000 | 72,202.11 | 0.09 |
| 41 | 01918 | 融创中国 | 42,000 | 44,082.44 | 0.05 |
| 42 | 002322 | 理工能科 | 2,700 | 43,254.00 | 0.05 |
| 43 | 00631 | 三一国际 | 7,000 | 31,049.37 | 0.04 |
| 44 | 00152 | 深圳国际 | 3,500 | 19,900.99 | 0.02 |

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 | 600961 | 株冶集团 | 1,133,097.00 | 0.97 |
| 2 | 00960 | 龙湖集团 | 591,045.93 | 0.50 |
| 3 | 01208 | 五矿资源 | 462,267.59 | 0.39 |
| 4 | 002155 | 湖南黄金 | 454,021.00 | 0.39 |
| 5 | 001979 | 招商蛇口 | 376,680.00 | 0.32 |
| 6 | 000768 | 中航西飞 | 373,212.00 | 0.32 |
| 7 | 00981 | 中芯国际 | 367,092.46 | 0.31 |
| 8 | 600079 | 人福医药 | 339,082.00 | 0.29 |
| 9 | 02331 | 李宁 | 331,018.15 | 0.28 |
| 10 | 600835 | 上海机电 | 330,178.00 | 0.28 |
| 11 | 300750 | 宁德时代 | 327,083.00 | 0.28 |
| 12 | 600348 | 华阳股份 | 325,839.00 | 0.28 |
| 13 | 00525 | 广深铁路股份 | 297,776.99 | 0.25 |
| 14 | 300003 | 乐普医疗 | 296,075.00 | 0.25 |
| 15 | 601899 | 紫金矿业 | 296,008.00 | 0.25 |
| 16 | 688019 | 安集科技 | 244,461.91 | 0.21 |
| 17 | 603259 | 药明康德 | 240,955.00 | 0.21 |
| 18 | 000923 | 河钢资源 | 221,268.00 | 0.19 |
| 19 | 002387 | 维信诺 | 219,692.00 | 0.19 |
| 20 | 002120 | 韵达股份 | 207,961.00 | 0.18 |

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 | 00883 | 中国海洋石油 | 2,099,177.34 | 1.79 |
| 2 | 01208 | 五矿资源 | 1,867,813.74 | 1.59 |
| 3 | 601225 | 陕西煤业 | 1,680,331.00 | 1.43 |
| 4 | 00753 | 中国国航 | 1,436,675.10 | 1.23 |
| 5 | 601658 | 邮储银行 | 1,355,681.00 | 1.16 |
| 6 | 01898 | 中煤能源 | 1,145,906.73 | 0.98 |
| 7 | 600489 | 中金黄金 | 1,140,235.00 | 0.97 |
| 8 | 01093 | 石药集团 | 1,118,135.74 | 0.95 |
| 9 | 601666 | 平煤股份 | 948,047.50 | 0.81 |
| 10 | 000960 | 锡业股份 | 946,103.00 | 0.81 |
| 11 | 00168 | 青岛啤酒股份 | 867,878.06 | 0.74 |
| 12 | 601919 | 中远海控 | 766,156.00 | 0.65 |
| 13 | 000983 | 山西焦煤 | 761,715.00 | 0.65 |
| 14 | 03690 | 美团-W | 678,382.54 | 0.58 |

| | | | | |
|----|--------|--------|------------|------|
| 15 | 02020 | 安踏体育 | 635,944.64 | 0.54 |
| 16 | 600030 | 中信证券 | 620,382.00 | 0.53 |
| 17 | 02331 | 李宁 | 616,019.13 | 0.53 |
| 18 | 601600 | 中国铝业 | 602,925.00 | 0.51 |
| 19 | 002155 | 湖南黄金 | 601,832.00 | 0.51 |
| 20 | 01177 | 中国生物制药 | 596,885.24 | 0.51 |

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 | 10,607,598.72 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 29,325,434.02 |

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 6,454,971.37 | 7.72 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 5,290,046.45 | 6.33 |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 13,535,669.39 | 16.19 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 2,014,767.12 | 2.41 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 15,402,517.88 | 18.42 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 42,697,972.21 | 51.06 |

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 | 2028023 | 20 招商银行永续债 01 | 50,000 | 5,290,046.45 | 6.33 |
| 2 | 148131 | 22 润置 12 | 50,000 | 5,065,836.99 | 6.06 |
| 3 | 019709 | 23 国债 16 | 46,000 | 4,671,829.32 | 5.59 |
| 4 | 148382 | 23 蛇口 01 | 40,000 | 4,127,921.75 | 4.94 |
| 5 | 148362 | 23 润置 01 | 20,000 | 2,066,050.41 | 2.47 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 权证代码 | 权证名称 | 数量（份） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-------|--------|---------|-----------|--------------|
| 1 | 02960 | 五矿资源股权 | 169,600 | 53,402.73 | 0.06 |

7.10 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，将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。

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

本基金可基于谨慎原则，将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。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金可基于谨慎原则，将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。

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

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

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

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制

日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 8,875.20 |
| 2 | 应收清算款 | 1,078,248.99 |
| 3 | 应收股利 | 133,607.75 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 7,211.72 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,227,943.66 |

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 | 113050 | 南银转债 | 1,612,799.38 | 1.93 |
| 2 | 113066 | 平煤转债 | 1,529,354.01 | 1.83 |
| 3 | 110079 | 杭银转债 | 1,342,931.63 | 1.61 |
| 4 | 128048 | 张行转债 | 1,239,682.66 | 1.48 |
| 5 | 110073 | 国投转债 | 1,213,366.71 | 1.45 |
| 6 | 127020 | 中金转债 | 1,100,897.98 | 1.32 |
| 7 | 110075 | 南航转债 | 1,067,503.42 | 1.28 |
| 8 | 113043 | 财通转债 | 778,084.52 | 0.93 |
| 9 | 127085 | 韵达转债 | 542,798.00 | 0.65 |
| 10 | 118024 | 冠宇转债 | 512,084.05 | 0.61 |
| 11 | 127073 | 天赐转债 | 471,021.37 | 0.56 |
| 12 | 118034 | 晶能转债 | 374,872.79 | 0.45 |
| 13 | 110089 | 兴发转债 | 369,727.05 | 0.44 |
| 14 | 113065 | 齐鲁转债 | 328,313.14 | 0.39 |
| 15 | 113062 | 常银转债 | 280,189.22 | 0.34 |
| 16 | 123108 | 乐普转 2 | 264,551.93 | 0.32 |
| 17 | 113055 | 成银转债 | 261,963.75 | 0.31 |
| 18 | 113666 | 爱玛转债 | 248,804.00 | 0.30 |
| 19 | 127086 | 恒邦转债 | 229,745.32 | 0.27 |
| 20 | 118030 | 睿创转债 | 202,600.30 | 0.24 |
| 21 | 127038 | 国微转债 | 191,989.93 | 0.23 |
| 22 | 113053 | 隆 22 转债 | 168,905.59 | 0.20 |
| 23 | 110085 | 通 22 转债 | 158,650.52 | 0.19 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 24 | 113675 | 新 23 转债 | 137,960.32 | 0.16 |
| 25 | 128134 | 鸿路转债 | 125,296.74 | 0.15 |
| 26 | 113059 | 福莱转债 | 118,561.38 | 0.14 |
| 27 | 113021 | 中信转债 | 92,159.56 | 0.11 |
| 28 | 113655 | 欧 22 转债 | 69,127.45 | 0.08 |
| 29 | 118000 | 嘉元转债 | 66,151.28 | 0.08 |
| 30 | 127044 | 蒙娜转债 | 64,752.06 | 0.08 |
| 31 | 113584 | 家悦转债 | 54,163.31 | 0.06 |
| 32 | 128136 | 立讯转债 | 53,673.55 | 0.06 |
| 33 | 127056 | 中特转债 | 47,015.58 | 0.06 |
| 34 | 123107 | 温氏转债 | 42,907.67 | 0.05 |
| 35 | 113044 | 大秦转债 | 26,458.32 | 0.03 |
| 36 | 123121 | 帝尔转债 | 10,215.30 | 0.01 |
| 37 | 113605 | 大参转债 | 2,147.17 | 0.00 |
| 38 | 127066 | 科利转债 | 1,090.92 | 0.00 |

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

| 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 (%) |
| 景顺长城安瑞混合 A | 951 | 39,522.83 | 116.68 | 0.00 | 37,586,092.70 | 100.00 |
| 景顺长城安瑞混合 C | 725 | 54,072.04 | 16,038,657.54 | 40.91 | 23,163,570.06 | 59.09 |
| 合计 | 1,676 | 45,816.49 | 16,038,774.22 | 20.89 | 60,749,662.76 | 79.11 |

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

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 | 景顺长城安瑞混合 A | 528,012.96 | 1.404805 |
| | 景顺长城安瑞混合 C | 27.05 | 0.000069 |
| | 合计 | 528,040.01 | 0.687656 |

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 | 景顺长城安瑞混合 A | — |
| | 景顺长城安瑞混合 C | — |
| | 合计 | — |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 景顺长城安瑞混合 A | 50~100 |
| | 景顺长城安瑞混合 C | — |
| | 合计 | 50~100 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 景顺长城安瑞混合 A | 景顺长城安瑞混合 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日(2022年9月23日)基金份额总额 | 267,185,948.11 | 94,044,910.33 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 67,626,101.51 | 48,339,562.83 |
| 本报告期基金总申购份额 | 4,825,338.42 | 7,515,345.66 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 34,865,230.55 | 16,652,680.89 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | — | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 37,586,209.38 | 39,202,227.60 |

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。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------------|--------|---------------|-----------------|-----------|---------------|-----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | |
| 兴业证券股份有限公司 | 2 | 39,933,032.74 | 100.00 | 35,313.11 | 100.00 | 未变更 |
| 山西证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 未变更 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | 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 (%) |
| 兴业证券股份有限公司 | 61,937,282.54 | 100.00 | 223,449,000.00 | 100.00 | - | - |
| 山西证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|--------------|-----------------|
| 1 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回及转换业务安排的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 1 月 4 日 |
| 2 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增玄元保险为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 1 月 5 日 |
| 3 | 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 |
| 4 | 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 |

| | | | |
|----|---|------------------|-----------------|
| 5 | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金 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 |
| 6 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统 停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及 网站 | 2024 年 3 月 22 日 |
| 7 | 关于警惕假冒景顺长城基金 APP 开展 诈骗活动的声明 | 中国证监会指定报刊及 网站 | 2024 年 3 月 27 日 |
| 8 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下 部分基金非港股通交易日暂停申购、 赎回等业务安排的提示性公告 | 中国证监会指定报刊及 网站 | 2024 年 3 月 28 日 |
| 9 | 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 |
| 10 | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金 2023 年年度报告 | 中国证监会指定报刊及 网站 | 2024 年 3 月 29 日 |
| 11 | 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 |
| 12 | 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 |
| 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 | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金 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 |
| 15 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下 部分基金非港股通交易日暂停申购、 赎回等业务安排的提示性公告 | 中国证监会指定报刊及 网站 | 2024 年 5 月 13 日 |
| 16 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统 停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及 网站 | 2024 年 5 月 24 日 |
| 17 | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金 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 |
| 18 | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金基 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 |
| 19 | 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 |
| 20 | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金基 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 |
| 21 | 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 |
| 22 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下 部分基金非港股通交易日暂停申购、 赎回等业务安排的提示性公告 | 中国证监会指定报刊及 网站 | 2024 年 6 月 27 日 |
| 23 | 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安瑞混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城安瑞混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城安瑞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。

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