

# 长江量化匠心甄选股票型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:长江证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月22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2022年01月01日起至06月30日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	1
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
§ 2 基金简介 .....	4
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	4
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....	5
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	6
§ 4 管理人报告 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	12
§ 5 托管人报告 .....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	12
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 .....	12
§ 6 中期财务会计报告(未经审计) .....	12
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	14
6.3 净资产(基金净值)变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	18
§ 7 投资组合报告 .....	39
7.1 期末基金资产组合情况 .....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	39
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 .....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	47
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 .....	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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	47
§ 8 基金份额持有人信息 .....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	49

§ 9 开放式基金份额变动 .....	50
§ 10 重大事件揭示 .....	50
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	51
§ 11 备查文件目录 .....	52
11.1 备查文件目录 .....	52
11.2 存放地点 .....	53
11.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长江量化匠心甄选股票型证券投资基金	
基金简称	长江量化匠心甄选	
基金主代码	006911	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年04月25日	
基金管理人	长江证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,937,316.37份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长江量化匠心甄选A	长江量化匠心甄选C
下属分级基金的交易代码	006911	006957
报告期末下属分级基金的份额总额	1,757,912.10份	6,179,404.27份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以量化模型为基础，在有效控制投资风险的前提下，力求实现健康、稳定的超越业绩比较基准的投资回报，追求资产的长期增值。
投资策略	本基金利用量化投资模型，在严格控制投资风险的前提下，力求投资业绩达到或超越业绩比较基准。
业绩比较基准	中证500指数收益率*95%+商业银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长江证券（上海）资产管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高杨
	联系电话	4001-166-866
	电子邮箱	zgxxpl@cjsc.com.cn
		李帅帅
		0755-25878287
		LISHUAI130@ping

		an.com.cn
客户服务电话	4001-166-866	95511-3
传真	021-80301393	0755-82080387
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号世纪汇一座27层	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层	广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座26楼
邮政编码	200122	518001
法定代表人	周纯	谢永林

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长江证券（上海）资产管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	长江量化匠心甄选A	长江量化匠心甄选C
本期已实现收益	-303,158.93	-1,146,005.09
本期利润	-69,366.25	-319,963.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0393	-0.0486
本期加权平均净值利润率	-3.22%	-4.07%

本期基金份额净值增长率	-2.70%	-2.99%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	559,147.64	1,791,900.91
期末可供分配基金份额利润	0.3181	0.2900
期末基金资产净值	2,317,059.74	7,971,305.18
期末基金份额净值	1.3181	1.2900
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	31.81%	29.00%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。（2）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；表中的“期末”均指报告期最后一日，即2022年6月30日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。（3）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 长江量化匠心甄选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	10.54%	1.37%	6.74%	1.05%	3.80%	0.32%
过去三个月	10.46%	1.61%	1.99%	1.66%	8.47%	-0.05%
过去六个月	-2.70%	1.50%	-11.65%	1.55%	8.95%	-0.05%
过去一年	-14.05%	1.29%	-4.83%	1.26%	-9.22%	0.03%
过去三年	26.94%	1.37%	29.13%	1.28%	-2.19%	0.09%
自基金合同生效起至今	31.81%	1.34%	13.38%	1.32%	18.43%	0.02%

#### 长江量化匠心甄选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	10.48%	1.37%	6.74%	1.05%	3.74%	0.32%
过去三个月	10.29%	1.61%	1.99%	1.66%	8.30%	-0.05%
过去六个月	-2.99%	1.50%	-11.65%	1.55%	8.66%	-0.05%
过去一年	-14.56%	1.29%	-4.83%	1.26%	-9.73%	0.03%
过去三年	24.49%	1.37%	29.13%	1.28%	-4.64%	0.09%
自基金合同 生效起至今	29.00%	1.34%	13.38%	1.32%	15.62%	0.02%

注：本基金基金合同于2019年4月25日生效，业绩比较基准为中证500指数收益率\*95%+商业银行活期存款利率（税后）\*5%。

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

长江量化匠心甄选A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年04月25日-2022年06月30日)





长江量化匠心甄选C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年04月25日-2022年06月30日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至本报告期末，本基金管理人管理的基金有长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐享货币市场基金、长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐越定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、长江量化匠心甄选股票型证券投资基金、长江安盈中短债六个月定期开放债券型证券投资基金、长江添利混合型证券投资基金、长江安享纯债18个月定期开放债券型证券投资基金、长江均衡成长混合型发起式证券投资基金、长江量化消费精选股票型发起式证券

投资基金、长江新能源产业混合型发起式证券投资基金、长江沪深300指数增强型发起式证券投资基金、长江量化科技精选一个月滚动持有股票型发起式证券投资基金、长江双盈6个月持有期债券型发起式证券投资基金、长江红利回报混合型发起式证券投资基金、长江致惠30天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、长江鑫选3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长江智能制造混合型发起式证券投资基金、长江新兴产业混合型发起式证券投资基金、长江丰瑞3个月持有期债券型证券投资基金、长江启航混合型发起式证券投资基金、长江尊利债券型证券投资基金、长江智选3个月持有期混合型基金中基金（FOF）、长江聚利债券型证券投资基金。

#### 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		
秦昌贵	基金经理	2021-01-11	-	17年	国籍：中国。硕士研究生，具备基金从业资格。曾任长江证券有限责任公司衍生产品部研究员，长江证券股份有限公司资产管理总部产品开发部主管、量化投资部主管，长江证券（上海）资产管理有限公司量化投资部总经理，创金合信基金管理有限公司量化投资部副总监、CTA投资部总监。现任长江证券（上海）资产管理有限公司量化投资部总经理，长江量化匠心甄选股票型证券投资基金、长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金、长江沪深300指数增强型发起式证券投资基金、长江量化科技精选一个月滚动持有股票型发起式证券投资基金基金

					经理。
--	--	--	--	--	-----

注：（1）此处的任职日期、离职日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；（2）证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### （一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

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

##### （二）扩展时间窗口下的价差分析

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

##### （三）基金或组合间模拟溢价金额分析

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年上半年市场整体大幅波动，一至四月份市场经历了几波快速下跌行情，主要宽基指数估值水平在四月底触底后大幅反弹。在股票选择方面，我们重点关注上市公司的财务状况及股票的交易状况，优先选择在价值和成长方面较为平衡的个股进行配置，并尽量规避财务杠杆高、现金流缺乏、公司成长稳定性差及运营能力差的公司；同时利用交易指标刻画股票的投机情绪，规避短期投机情绪高的个股。投资管理上，我们坚持采用量化模型对股票进行筛选和权重分配，优先选择业绩稳定、成长性好、估值具有优势的股票构建组合。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金A类份额净值为1.3181元，C类份额净值为1.2900元；本报告期内，本基金A类份额净值增长率为-2.70%，C类份额净值增长率为-2.99%，同期业绩比较基准收益率为-11.65%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着国内疫情的好转以及复工复产的推进，上市公司的成长预期、市场占有率、业绩稳定性依然是市场关注点。在具体选股策略上，我们将依然采用量化选股策略，运用量化模型驱动的投资方法精选股票构建备选池，并定期对模型进行调整，以改进模型的有效性。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

估值委员会由公司领导、运营部、财务部、权益研究部、固定收益研究部、法律合规部、风险管理部等相关部门工作人员组成。估值委员会成员具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存

在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情况；本基金自2019年5月28日起至2022年6月30日存在连续60个工作日基金资产净值低于五千万的情形，基金管理人已向中国证监会报告并提交了解决方案。

### § 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：长江量化匠心甄选股票型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	820,425.62	992,981.16
结算备付金		55,773.06	1,628.07
存出保证金		2,509.25	1,876.21
交易性金融资产	6.4.7.2	9,457,840.80	10,366,960.87
其中：股票投资		9,457,840.80	10,366,960.87
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		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		31,122.02	5,394.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	116.47
资产总计		10,367,670.75	11,368,957.47
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>

<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		5,189.94	10,010.57
应付管理人报酬		12,322.10	14,119.30
应付托管费		1,642.97	1,882.57
应付销售服务费		3,839.30	4,414.28
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	6.4.7.6	56,311.52	91,907.56
负债合计		79,305.83	122,334.28
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	7,937,316.37	8,424,031.32
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	2,351,048.55	2,822,591.87
净资产合计		10,288,364.92	11,246,623.19
负债和净资产总计		10,367,670.75	11,368,957.47

注：报告截止日2022年6月30日，A类基金份额净值1.3181元，基金份额总额1,757,912.10份；C类基金份额净值1.2900元，基金份额总额6,179,404.27份。

## 6.2 利润表

会计主体：长江量化匠心甄选股票型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年01月01日	上年度可比期间 2021年01月01日
-----	-----	-------------------	------------------------

		至2022年06月30日	至2021年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		-251,834.28	326,184.45
1. 利息收入		2,126.51	4,099.83
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,126.51	3,565.80
债券利息收入		-	10.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	523.37
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,314,310.67	2,424,851.41
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,414,079.82	2,338,577.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	1,694.74
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	99,769.15	84,579.57
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	1,059,834.16	-2,106,830.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	515.72	4,063.45
<b>减：二、营业总支出</b>		137,495.58	293,214.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	74,438.91	110,546.04
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,925.22	14,739.51
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	23,378.67	35,551.18



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	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	0.04
8. 其他费用	6.4.7.17	29,752.78	132,377.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-389,329.86	32,970.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-389,329.86	32,970.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-389,329.86	32,970.00

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长江量化匠心甄选股票型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	8,424,031.32	-	2,822,591.87	11,246,623.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	8,424,031.32	-	2,822,591.87	11,246,623.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-486,714.95	-	-471,543.32	-958,258.27
（一）、综合收益总额	-	-	-389,329.86	-389,329.86

（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-486,714.95	-	-82,213.46	-568,928.41
其中：1. 基金申购款	1,131,697.55	-	244,685.93	1,376,383.48
2. 基金赎回款	-1,618,412.50	-	-326,899.39	-1,945,311.89
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	7,937,316.37	-	2,351,048.55	10,288,364.92
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	15,482,555.29	-	9,010,738.93	24,493,294.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	15,482,555.29	-	9,010,738.93	24,493,294.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,622,608.55	-	-4,960,004.28	-12,582,612.83
（一）、综合收益总额	-	-	32,970.00	32,970.00
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-7,622,608.55	-	-4,992,974.28	-12,615,582.83
其中：1. 基金申购款	3,414,338.10	-	1,931,099.90	5,345,438.00

2. 基金赎回款	-11,036,946.65	-	-6,924,074.18	-17,961,020.83
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	7,859,946.74	-	4,050,734.65	11,910,681.39

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：

周纯

杨忠

何永生

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长江量化匠心甄选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[2018]2079号文《关于准予长江量化匠心甄选股票型证券投资基金注册的批复》准予注册,由长江证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江量化匠心甄选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,基金存续期限为不定期,首次设立募集资金为214,868,981.20元,认购资金在募集期间产生的利息为20,374.88元,合计为214,889,356.08元,按照每份基金份额面值人民币1.00元计算,折合基金份额为214,889,356.08份,业经中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)众环验字(2019)010021号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长江量化匠心甄选股票型证券投资基金基金合同》于2019年4月25日正式生效。本基金的基金管理人为长江证券(上海)资产管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江量化匠心甄选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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产

支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产的比例不低于 80%；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、应收申购款等。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2022年6月30日的财务状况、自2022年1月1日至2022年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

除下文6.4.5.1会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金本报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度报告所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自2022年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第23号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第24号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第37号——金融工具列报(修订)》（统称“新金融工具准则”）和2022年中国证监会发布的修订的《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〉》。

##### (1) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于2006年颁布的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》和《企业会计准则第24号——套期保值》以及财政部于2014年修订的《企业会计准则第37号——金融工具列报》（统称“原金融工具准则”）。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产的未来现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即2022年1月1日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入2022年年初留存收益或其他综合收益。

执行新金融工具准则对2022年1月1日本基金资产负债表各项目的的影响汇总如下：

（i）金融工具的分类影响

（a）以摊余成本计量的金融资产

于2021年12月31日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，对应的账面价值分别为人民币992,981.16元、1,628.07元、1,876.21元、116.47元和5,394.69元。

于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收申购款，对应的账面价值分别为人民币993,095.87元、1,628.84元、1,877.20元和5,394.69元。

（b）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于2021年12月31日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币10,366,960.87元。

于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币10,366,960.87元。

#### (c) 以摊余成本计量的金融负债

于2021年12月31日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债，对应的账面价值分别为人民币10,010.57元、14,119.30元、1,882.57元、4,414.28元、31,906.23元和60,001.33元。

于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币10,010.57元、14,119.30元、1,882.57元、4,414.28元和91,907.56元。

于2021年12月31日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### (ii) 采用“预期信用损失”模型的影响

“预期信用损失”模型适用于本基金持有的以摊余成本计量的金融资产。采用“预期信用损失”模型未对本基金2022年年初留存收益产生重大影响。

#### (2) 修订的《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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别

化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(3) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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

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

本基金运作过程中涉及的各纳税主体、纳税义务按上述税收法律法规执行。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	820,425.62
等于：本金	820,338.85

加：应计利息	86.77
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	820,425.62

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	8,403,405.69	-	9,457,840.80	1,054,435.11
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	8,403,405.69	-	9,457,840.80	1,054,435.11



**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/负债余额。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产余额。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.48
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	26,558.26
其中：交易所市场	26,558.26
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	29,752.78
合计	56,311.52

**6.4.7.7 实收基金****6.4.7.7.1 长江量化匠心甄选A**

金额单位：人民币元

项目 (长江量化匠心甄选A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,780,836.79	1,780,836.79
本期申购	75,469.25	75,469.25
本期赎回（以“-”号填列）	-98,393.94	-98,393.94
本期末	1,757,912.10	1,757,912.10

## 6.4.7.7.2 长江量化匠心甄选C

金额单位：人民币元

项目 (长江量化匠心甄选C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,643,194.53	6,643,194.53
本期申购	1,056,228.30	1,056,228.30
本期赎回（以“-”号填列）	-1,520,018.56	-1,520,018.56
本期末	6,179,404.27	6,179,404.27

注：上述“申购”含红利再投、转换入份额，“赎回”含转换出份额。

## 6.4.7.8 未分配利润

## 6.4.7.8.1 长江量化匠心甄选A

单位：人民币元

项目 (长江量化匠心甄选A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,014,891.13	-383,198.95	631,692.18
本期利润	-303,158.93	233,792.68	-69,366.25
本期基金份额交易产生的变动数	-10,185.48	7,007.19	-3,178.29
其中：基金申购款	35,476.00	-16,587.41	18,888.59
基金赎回款	-45,661.48	23,594.60	-22,066.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	701,546.72	-142,399.08	559,147.64

## 6.4.7.8.2 长江量化匠心甄选C

单位：人民币元

项目 (长江量化匠心甄选C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,601,475.59	-1,410,575.90	2,190,899.69
本期利润	-1,146,005.09	826,041.48	-319,963.61
本期基金份额交易产生的变动数	-162,636.74	83,601.57	-79,035.17
其中：基金申购款	484,092.19	-258,294.85	225,797.34
基金赎回款	-646,728.93	341,896.42	-304,832.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,292,833.76	-500,932.85	1,791,900.91

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	1,636.90
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	463.51
其他	26.10
合计	2,126.51

## 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	35,813,617.97
减：卖出股票成本总额	37,135,097.11
减：交易费用	92,600.68
买卖股票差价收入	-1,414,079.82

**6.4.7.11 债券投资收益****6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益—买卖债券差价收入。

**6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

**6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

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

本基金本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

**6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无衍生工具收益—其他投资收益。

**6.4.7.13 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	99,769.15
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	99,769.15

**6.4.7.14 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	1,059,834.16

——股票投资	1,059,834.16
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,059,834.16

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	515.72
合计	515.72

#### 6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
审计费用	29,752.78
合计	29,752.78

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长江证券（上海）资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人股东、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未产生应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年01月01日至2022年06月30日	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	74,438.91	110,546.04
其中：支付销售机构的客户维护费	37,152.31	55,183.42

注：（1）本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

（2）基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,925.22	14,739.51

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

（2）基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	长江量化匠心甄选A	长江量化匠心甄选C	合计
平安银行股份有限公司	0.00	515.59	515.59
长江证券股份有限公司	0.00	1,600.86	1,600.86
长江证券（上海）资产管理有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	2,116.45	2,116.45
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长江量化匠心甄选A	长江量化匠心甄选C	合计
平安银行股份有限公司	0.00	1,170.26	1,170.26
长江证券股份有限公司	0.00	3,100.49	3,100.49
长江证券（上海）资产管理有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	4,270.75	4,270.75

注：（1）本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.60%年费率计提。C类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

（2）销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易



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

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期及上年度可比期间均不存在基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	820,425.62	1,636.90	902,929.70	2,657.24

注：上述银行存款由基金托管人平安银行股份有限公司保管，按约定利率计息

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0元，无质押债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0元，无质押债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金运作周期内的每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	820,425.62	-	-	-	820,425.62
结算备付金	55,773.06	-	-	-	55,773.06
存出保证金	2,509.25	-	-	-	2,509.25

交易性金融资产	-	-	-	9,457,840.80	9,457,840.80
应收申购款	-	-	-	31,122.02	31,122.02
资产总计	878,707.93	-	-	9,488,962.82	10,367,670.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,189.94	5,189.94
应付管理人报酬	-	-	-	12,322.10	12,322.10
应付托管费	-	-	-	1,642.97	1,642.97
应付销售服务费	-	-	-	3,839.30	3,839.30
其他负债	-	-	-	56,311.52	56,311.52
负债总计	-	-	-	79,305.83	79,305.83
利率敏感度缺口	878,707.93	-	-	9,409,656.99	10,288,364.92
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产					
银行存款	992,981.16	-	-	-	992,981.16
结算备付金	1,628.07	-	-	-	1,628.07
存出保证金	1,876.21	-	-	-	1,876.21
交易性金融资产	-	-	-	10,366,960.87	10,366,960.87
应收利息	-	-	-	116.47	116.47
应收申购款	-	-	-	5,394.69	5,394.69
资产总计	996,485.44	-	-	10,372,472.03	11,368,957.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,010.57	10,010.57
应付管理人报酬	-	-	-	14,119.30	14,119.30
应付托管费	-	-	-	1,882.57	1,882.57
应付销售服务费	-	-	-	4,414.28	4,414.28
应付交易费用	-	-	-	31,906.23	31,906.23
其他负债	-	-	-	60,001.33	60,001.33
负债总计	-	-	-	122,334.28	122,334.28
利率敏感度缺口	996,485.44	-	-	10,250,137.75	11,246,623.19

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

2022年6月30日及上年度末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所及银行间同业市场交易的股票和固定收益品种，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种方法对基金进行风险度量，以及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021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	9,457,840.80	91.93	10,366,960.87	92.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	9,457,840.80	91.93	10,366,960.87	92.18

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系
----	--

	数在资产负债表日后短期内保持不变。		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上涨5%	460,714.45	597,561.73
	业绩比较基准下跌5%	-460,714.45	-597,561.73

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

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	9,457,840.80	10,366,960.87
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	9,457,840.80	10,366,960.87

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2022年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	9,457,840.80	91.22
	其中：股票	9,457,840.80	91.22
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	876,198.68	8.45
8	其他各项资产	33,631.27	0.32
9	合计	10,367,670.75	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合



## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,618,142.00	15.73
C	制造业	6,534,444.80	63.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	124,857.00	1.21
E	建筑业	49,734.00	0.48
F	批发和零售业	166,577.00	1.62
G	交通运输、仓储和邮政业	233,555.00	2.27
H	住宿和餐饮业	64,480.00	0.63
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,120.00	0.28
J	金融业	438,008.00	4.26
K	房地产业	157,415.00	1.53
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	41,508.00	0.40
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	9,457,840.80	91.93

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600438	通威股份	6,600	395,076.00	3.84
2	002460	赣锋锂业	2,000	297,400.00	2.89
3	002709	天赐材料	4,700	291,682.00	2.84

4	601898	中煤能源	28,100	291,678.00	2.84
5	601012	隆基绿能	3,920	261,189.60	2.54
6	300390	天华超净	2,700	235,980.00	2.29
7	002459	晶澳科技	2,660	209,874.00	2.04
8	600256	广汇能源	19,500	205,530.00	2.00
9	000596	古井贡酒	800	199,728.00	1.94
10	603612	索通发展	5,300	195,305.00	1.90
11	600873	梅花生物	16,200	182,736.00	1.78
12	600111	北方稀土	5,100	179,316.00	1.74
13	600123	兰花科创	9,800	161,210.00	1.57
14	300751	迈为股份	320	157,088.00	1.53
15	002318	久立特材	9,600	153,504.00	1.49
16	000333	美的集团	2,200	132,858.00	1.29
17	600580	卧龙电驱	9,000	129,780.00	1.26
18	000651	格力电器	3,800	128,136.00	1.25
19	688298	东方生物	1,120	127,848.00	1.24
20	603599	广信股份	4,480	126,112.00	1.23
21	600188	兖矿能源	3,100	122,388.00	1.19
22	603605	珀莱雅	720	118,929.60	1.16
23	600141	兴发集团	2,700	118,773.00	1.15
24	002180	纳思达	2,300	116,426.00	1.13
25	600063	皖维高新	15,300	115,974.00	1.13
26	600901	江苏租赁	22,500	115,425.00	1.12
27	600908	无锡银行	20,300	114,289.00	1.11
28	600064	南京高科	10,300	113,300.00	1.10
29	000630	铜陵有色	34,600	112,796.00	1.10
30	601168	西部矿业	9,300	110,019.00	1.07
31	601699	潞安环能	7,500	109,650.00	1.07
32	000733	振华科技	800	108,776.00	1.06
33	601009	南京银行	10,400	108,368.00	1.05
34	600486	扬农化工	800	106,624.00	1.04

35	601156	东航物流	5,300	104,940.00	1.02
36	300803	指南针	1,700	99,926.00	0.97
37	600233	圆通速递	4,900	99,911.00	0.97
38	600985	淮北矿业	6,600	96,096.00	0.93
39	601238	广汽集团	6,300	96,012.00	0.93
40	002643	万润股份	4,600	95,956.00	0.93
41	002128	电投能源	6,700	95,944.00	0.93
42	000983	山西焦煤	7,100	95,069.00	0.92
43	300073	当升科技	1,000	90,340.00	0.88
44	002129	TCL中环	1,300	76,557.00	0.74
45	002572	索菲亚	2,600	71,500.00	0.69
46	600765	中航重机	2,120	68,221.60	0.66
47	600859	王府井	2,500	64,950.00	0.63
48	600258	首旅酒店	2,600	64,480.00	0.63
49	600060	海信视像	4,900	61,250.00	0.60
50	000875	吉电股份	8,700	60,465.00	0.59
51	600732	爱旭股份	1,800	59,436.00	0.58
52	000738	航发控制	2,100	59,010.00	0.57
53	600153	建发股份	4,500	58,815.00	0.57
54	600085	同仁堂	1,100	58,168.00	0.57
55	600522	中天科技	2,500	57,750.00	0.56
56	603596	伯特利	700	56,126.00	0.55
57	000762	西藏矿业	1,000	55,930.00	0.54
58	300438	鹏辉能源	900	55,305.00	0.54
59	603305	旭升股份	1,800	54,396.00	0.53
60	002407	多氟多	1,100	53,801.00	0.52
61	300750	宁德时代	100	53,400.00	0.52
62	688516	奥特维	200	53,390.00	0.52
63	601857	中国石油	9,900	52,470.00	0.51
64	603979	金诚信	2,700	52,137.00	0.51
65	600096	云天化	1,600	50,368.00	0.49

66	601390	中国中铁	8,100	49,734.00	0.48
67	000519	中兵红箭	1,700	49,555.00	0.48
68	002497	雅化集团	1,500	48,975.00	0.48
69	601808	中海油服	3,500	48,825.00	0.47
70	300696	爱乐达	1,100	48,345.00	0.47
71	600348	华阳股份	3,100	47,926.00	0.47
72	300035	中科电气	1,700	47,515.00	0.46
73	600968	海油发展	18,100	46,698.00	0.45
74	002539	云图控股	2,900	46,371.00	0.45
75	300861	美畅股份	500	46,345.00	0.45
76	601865	福莱特	1,200	45,720.00	0.44
77	002756	永兴材料	300	45,663.00	0.44
78	002216	三全食品	2,300	45,057.00	0.44
79	600236	桂冠电力	7,300	44,457.00	0.43
80	002244	滨江集团	5,100	44,115.00	0.43
81	002895	川恒股份	1,300	43,953.00	0.43
82	601208	东材科技	3,400	43,928.00	0.43
83	300777	中简科技	900	43,380.00	0.42
84	600546	山煤国际	2,200	42,812.00	0.42
85	600378	昊华科技	1,100	42,372.00	0.41
86	603588	高能环境	3,600	41,508.00	0.40
87	000893	亚钾国际	1,200	41,292.00	0.40
88	000810	创维数字	2,400	38,904.00	0.38
89	603606	东方电缆	500	38,300.00	0.37
90	688122	西部超导	400	36,880.00	0.36
91	688200	华峰测控	100	35,640.00	0.35
91	600456	宝钛股份	600	35,640.00	0.35
93	603236	移远通信	260	34,751.60	0.34
94	603659	璞泰来	400	33,760.00	0.33
95	300398	飞凯材料	1,400	32,004.00	0.31
96	603826	坤彩科技	500	29,430.00	0.29

97	600575	淮河能源	9,200	28,704.00	0.28
98	002371	北方华创	100	27,712.00	0.27
99	300171	东富龙	800	27,128.00	0.26
100	300432	富临精工	1,100	24,200.00	0.24
101	603868	飞科电器	300	22,725.00	0.22
102	601689	拓普集团	300	20,529.00	0.20
103	603033	三维股份	910	20,511.40	0.20
104	000155	川能动力	900	19,935.00	0.19
105	603198	迎驾贡酒	300	19,542.00	0.19
106	002544	普天科技	800	18,200.00	0.18
107	000999	华润三九	400	18,000.00	0.17
108	300054	鼎龙股份	700	14,819.00	0.14
109	600395	盘江股份	1,600	14,032.00	0.14
110	002832	比音勒芬	500	12,600.00	0.12
111	000968	蓝焰控股	1,200	12,540.00	0.12
112	600845	宝信软件	200	10,920.00	0.11

## 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	002271	东方雨虹	566,579.00	5.04
2	600438	通威股份	507,094.00	4.51
3	002709	天赐材料	462,225.00	4.11
4	002460	赣锋锂业	430,748.00	3.83
5	000708	中信特钢	415,972.00	3.70
6	600372	中航电子	381,568.00	3.39
7	603260	合盛硅业	363,862.00	3.24
8	002244	滨江集团	345,361.00	3.07
9	300122	智飞生物	343,617.00	3.06
10	600426	华鲁恒升	323,141.90	2.87

11	000776	广发证券	317,622.00	2.82
12	601898	中煤能源	314,227.00	2.79
13	300285	国瓷材料	309,676.00	2.75
14	600968	海油发展	308,531.00	2.74
15	601899	紫金矿业	302,528.00	2.69
16	002821	凯莱英	295,601.00	2.63
17	600873	梅花生物	293,624.00	2.61
18	600018	上港集团	292,693.00	2.60
19	300316	晶盛机电	290,675.00	2.58
20	300390	天华超净	285,075.00	2.53
21	000596	古井贡酒	269,930.00	2.40
22	000062	深圳华强	265,642.00	2.36
23	000983	山西焦煤	250,305.00	2.23
24	603568	伟明环保	237,082.00	2.11
25	601390	中国中铁	236,127.00	2.10
26	300059	东方财富	231,385.00	2.06
27	300033	同花顺	230,232.00	2.05

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；（2）本项“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000708	中信特钢	631,643.80	5.62
2	600426	华鲁恒升	619,216.00	5.51
3	002271	东方雨虹	536,826.00	4.77
4	601899	紫金矿业	532,414.00	4.73
5	300059	东方财富	517,523.20	4.60
6	300122	智飞生物	517,234.00	4.60
7	600018	上港集团	514,852.00	4.58

8	600438	通威股份	440,419.00	3.92
9	600036	招商银行	402,727.00	3.58
10	002709	天赐材料	385,385.00	3.43
11	300033	同花顺	384,924.00	3.42
12	603486	科沃斯	359,213.00	3.19
13	600176	中国巨石	353,438.00	3.14
14	603260	合盛硅业	348,845.00	3.10
15	002493	荣盛石化	346,873.00	3.08
16	002244	滨江集团	346,020.00	3.08
17	300285	国瓷材料	333,493.00	2.97
18	002821	凯莱英	329,490.00	2.93
19	000568	泸州老窖	326,595.79	2.90
20	600372	中航电子	319,461.00	2.84
21	601919	中远海控	300,603.00	2.67
22	300316	晶盛机电	292,127.00	2.60
23	600406	国电南瑞	290,523.00	2.58
24	000062	深圳华强	266,207.00	2.37
25	000776	广发证券	262,521.00	2.33
26	600348	华阳股份	259,793.00	2.31
27	002241	歌尔股份	259,733.00	2.31
28	600141	兴发集团	246,475.00	2.19
29	000498	山东路桥	235,944.00	2.10
30	002027	分众传媒	227,609.00	2.02
31	600779	水井坊	225,809.00	2.01
32	600968	海油发展	225,310.00	2.00

注：（1）卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。（2）本项“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	35,166,142.88
卖出股票收入（成交）总额	35,813,617.97

注：（1）买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。（2）“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 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。

## 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

本基金在法律法规运行的范围内，审慎运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制投资组合风险、提高投资效率。

本基金本报告期末参与股指期货交易。

## 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

根据基金合同约定，本基金不得参与国债期货交易。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末参与国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注



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

7.12.2 本基金投资的前十名股票，没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,509.25
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	31,122.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,631.27

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情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	数 (户)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
长江 量化 匠心 甄选A	301	5,840.24	0.00	0.00%	1,757,912.10	100.0 0%
长江 量化 匠心 甄选C	2,728	2,265.18	25,563.03	0.41%	6,153,841.24	99.59%
合计	2,970	2,672.50	25,563.03	0.32%	7,911,753.34	99.68%

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

（2）户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从 业人员持有本基金	长江量化匠心甄选A	48,279.58	2.75%
	长江量化匠心甄选C	135.54	0.00%
	合计	48,415.12	0.61%

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

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基 金投资和研究部门负责人 持有本开放式基金	长江量化匠心甄选A	0~10
	长江量化匠心甄选C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开 放式基金	长江量化匠心甄选A	0~10
	长江量化匠心甄选C	0

	合计	0~10
--	----	------

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	长江量化匠心甄选A	长江量化匠心甄选C
基金合同生效日(2019年04月25日)基金份额总额	22,828,800.44	192,060,555.64
本报告期期初基金份额总额	1,780,836.79	6,643,194.53
本报告期基金总申购份额	75,469.25	1,056,228.30
减：本报告期基金总赎回份额	98,393.94	1,520,018.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,757,912.10	6,179,404.27

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内继续选聘中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	37,436,291.05	52.74%	26,754.98	52.75%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	33,543,469.80	47.26%	23,962.56	47.25%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于2亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金公司进行证券交易的需要，并能为基金公司提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

3、本基金本报告期内租用的券商交易单元未发生变更。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长江证券（上海）资产管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	规定报刊、网站	2022-01-01

2	长江证券（上海）资产管理有限公司关于开展网上服务系统应急演练的公告	规定报刊、网站	2022-01-06
3	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金2021年第四季度报告提示性公告	规定报刊	2022-01-24
4	长江量化匠心甄选股票型证券投资基金2021年第四季度报告	规定网站	2022-01-24
5	长江量化匠心甄选股票型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2022-03-31
6	长江量化匠心甄选股票型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2022-03-31
7	长江量化匠心甄选股票型证券投资基金招募说明书（更新）（2022年3月31日更新）	规定网站	2022-03-31
8	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金2021年年度报告提示性公告	规定报刊	2022-03-31
9	长江量化匠心甄选股票型证券投资基金2021年年度报告	规定网站	2022-03-31
10	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金2022年第一季度报告提示性公告	规定报刊	2022-04-22
11	长江量化匠心甄选股票型证券投资基金2022年第一季度报告	规定网站	2022-04-22
12	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上交易系统升级维护的公告	规定报刊、网站	2022-06-09
13	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上交易系统升级维护的公告	规定报刊、网站	2022-06-23

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予长江量化匠心甄选股票型证券投资基金募集申请的注册文件
- 2、长江量化匠心甄选股票型证券投资基金基金合同
- 3、长江量化匠心甄选股票型证券投资基金招募说明书
- 4、长江量化匠心甄选股票型证券投资基金托管协议
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照

7、本报告期内按照规定披露的各项公告

**11.2 存放地点**

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

**11.3 查阅方式**

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

长江证券（上海）资产管理有限公司  
二〇二二年八月三十一日