

景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 28 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 24 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	23

§ 8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
8.3 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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
8.6 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	70
8.7 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	70
8.8 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	70
8.9 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	71
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
8.12 投资组合报告附注	71
§ 9 基金份额持有人信息	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
9.3 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	72
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	72
§ 10 开放式基金份额变动	73
§ 11 重大事件揭示	73
11.1 基金份额持有人大会决议	73
11.2 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	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	78
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	83
12.1 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	83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	83
§ 13 备查文件目录	83
13.1 备查文件目录	83
13.2 存放地点	84
13.3 查阅方式	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城量化小盘股票
场内简称	无
基金主代码	005457
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月6日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	335,576,804.15份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型精选股票，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略： 本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略： 本基金主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。</p> <p>3、债券投资策略： 出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*95%+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，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
		王小飞
		021-60637103
		wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	4008888606	021-60637228
传真	0755-22381339	021-60635778
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	李进	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-153,152,782.37	60,724,703.83	86,373,902.12
本期利润	-192,848,570.78	72,670,568.84	74,458,900.75
加权平均基金份额本期利润	-0.3963	0.3689	0.4242
本期加权平均净值利润率	-24.56%	21.90%	37.20%
本期基金份额净值增长率	-17.50%	31.98%	42.45%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	172,774,137.11	319,030,729.85	39,194,995.42
期末可供分配基金份额	0.5149	0.8363	0.3913

利润			
期末基金资产净值	508,350,941.26	700,511,812.78	139,357,127.13
期末基金份额净值	1.5148	1.8362	1.3913
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	51.48%	83.62%	39.13%

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。

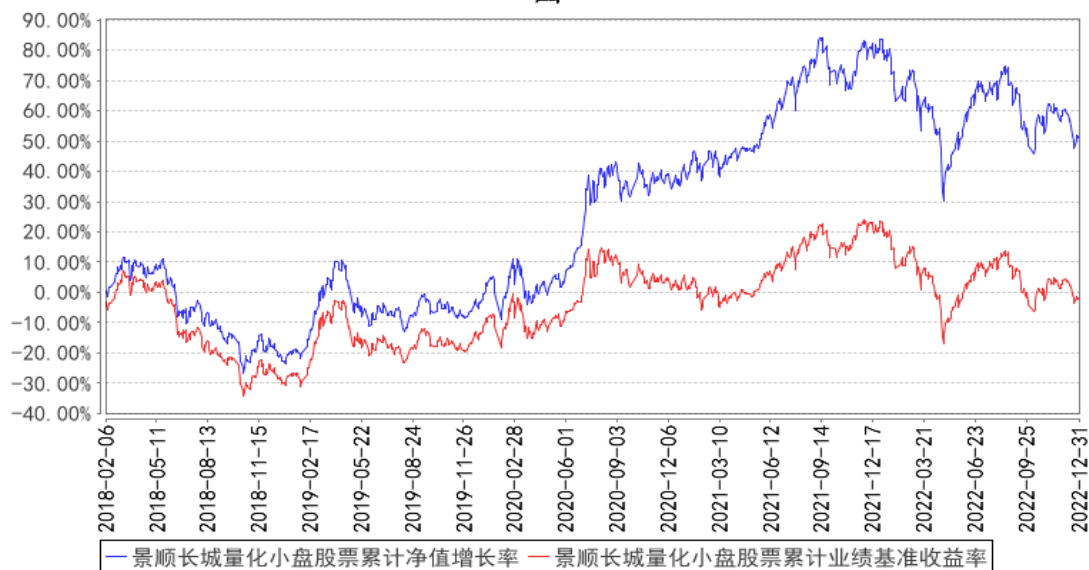
3.2 基金净值表现

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

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
过去三个月	2.00%	1.12%	2.46%	1.14%	-0.46%	-0.02%
过去六个月	-9.81%	1.20%	-9.67%	1.21%	-0.14%	-0.01%
过去一年	-17.50%	1.47%	-20.49%	1.51%	2.99%	-0.04%
过去三年	55.09%	1.43%	12.67%	1.45%	42.42%	-0.02%
自基金合同生效起至今	51.48%	1.45%	-1.89%	1.47%	53.37%	-0.02%

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

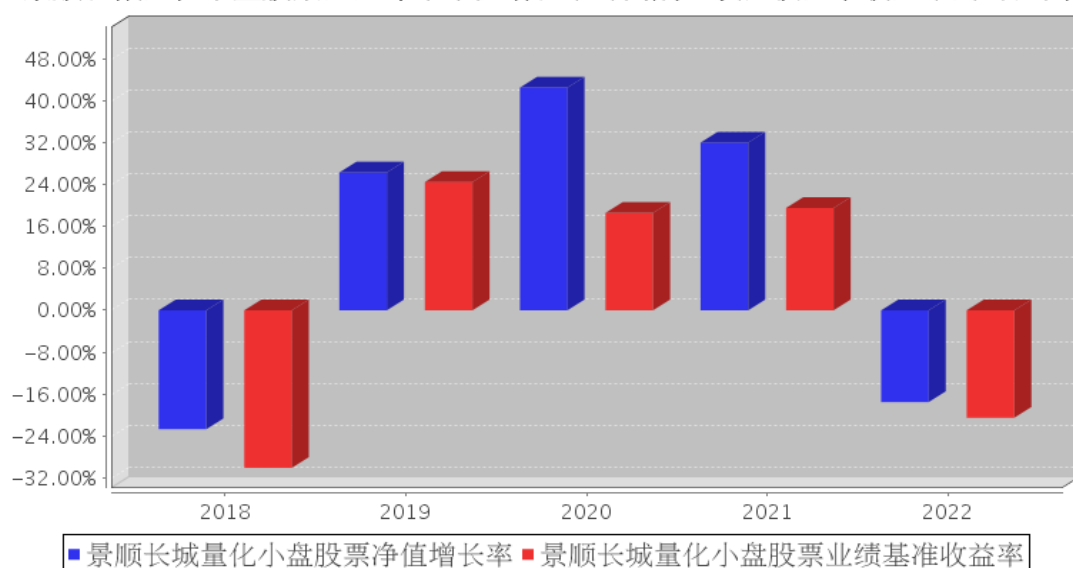
景顺长城量化小盘股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 80%–95%，投资于小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%–20%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的建仓期为自 2018 年 2 月 6 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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城量化小盘股票基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2018 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2018 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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 2022 年 12 月 31 日，本公司旗下共管理 165 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黎海威	本基金的基金经理	2018 年 2 月 6 日	-	19 年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有 19 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
第 9 页 共 84 页

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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据

投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 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投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 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 47 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

2022 年，新冠疫情对经济供需两侧多次产生冲击。2022 全年 GDP 增长 3%，工业增加值累计增长 3.6%。12 月 PMI 指数 47，疫情影响下景气指数持续回落。12 月 PPI 同比下跌 0.7%，环比下跌 0.5%；12 月 CPI 同比上涨 1.8%，环比持平，通胀无压力。12 月 M2 同比增速 11.8%，M1 同比增速 3.7%，全年社会融资规模存量同比增长 9.58%。12 月末外汇储备 3.1 万亿美元，人民币汇率波动有所放大。12 月底社会消费品零售总额同比下跌 1.8%，居民消费意愿持续下滑。整体来看，国内货币政策总体保持稳健，流动性合理适度，疫情影响下经济基本面有所下行。2022 年全年 A 股市场表现疲弱，风格方面价值优于成长，沪深 300、中证 500 和创业板指分别下跌 21.63%、20.31% 和 29.37%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2022 年度，本基金份额净值增长率为-17.50%，业绩比较基准收益率为-20.49%。

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 2023 年，海外方面，通胀预计将会得到缓解，美联储加息周期进入后半场，全球流动性压力减小。国内方面，随着防疫措施优化调整以及各项稳经济政策的出台，经济不确定性下降、居民预期随之改善，国内经济或将企稳复苏。宏观场景判断短期内倾向于“稳货币、宽信用”，当前经济处于复苏的早期阶段，尚需货币政策的呵护，预期货币保持合理充裕。而从中期视角看，随着经济复苏的演进，核心通胀有望恢复扩张，央行收敛货币的可能性在上升。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。我们的投资组合仍然会维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生长期投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及

时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

截至本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设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，本基金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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 24129 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城量化小盘股票型证券投资基金(以下简称“景顺长城量化小盘基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了景顺长城量化小盘基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于景顺长城量化小盘基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	景顺长城量化小盘基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设

	<p>计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估景顺长城量化小盘基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算景顺长城量化小盘基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督景顺长城量化小盘基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对景顺长城量化小盘基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城量化小盘基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 郭劲扬
会计师事务所的地址	中国上海市

审计报告日期	2023 年 3 月 24 日
--------	-----------------

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	29,280,457.86	82,491,581.55
结算备付金		2,485,449.52	4,201,935.28
存出保证金		316,290.19	130,491.44
交易性金融资产	7.4.7.2	479,660,016.70	652,780,759.73
其中：股票投资		479,660,016.70	652,422,359.73
基金投资		-	-
债券投资		-	358,400.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		3,765,276.40	-
应收股利		-	-
应收申购款		166,612.93	1,917,503.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	6,603.93
资产总计		515,674,103.60	741,528,875.57
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,989,206.15	34,080,529.04

应付赎回款		1,106,948.22	2,978,264.43
应付管理人报酬		702,986.93	846,890.40
应付托管费		117,164.47	141,148.38
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3.05	2.21
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	2,406,853.52	2,970,228.33
负债合计		7,323,162.34	41,017,062.79
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	335,576,804.15	381,481,082.93
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	172,774,137.11	319,030,729.85
净资产合计		508,350,941.26	700,511,812.78
负债和净资产总计		515,674,103.60	741,528,875.57

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5148 元，基金份额总额 335,576,804.15 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-178,922,465.20	87,101,459.45
1. 利息收入		283,880.59	123,123.62
其中：存款利息收入	7.4.7.13	283,880.59	122,907.78
债券利息收入		-	215.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-141,586,005.11	73,863,919.74
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-151,352,807.91	71,512,323.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	671,500.16	100,656.65
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-

收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	9,095,302.64	2,250,939.99
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）	7.4.7.20	-39,695,788.41	11,945,865.01
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	2,075,447.73	1,168,551.08
减：二、营业总支出		13,926,105.58	14,430,890.61
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	11,774,996.71	4,953,051.66
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,962,499.45	825,508.62
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2.60	0.67
8. 其他费用	7.4.7.23	188,606.82	8,652,329.66
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-192,848,570.78	72,670,568.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-192,848,570.78	72,670,568.84
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-192,848,570.78	72,670,568.84

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：2022年1月1日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31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	381,481,082.93	-	319,030,729.85	700,511,812.78

资产(基金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	381,481,082.93	-	319,030,729.85	700,511,812.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-45,904,278.78	-	-146,256,592.74	-192,160,871.52
(一)、综合收益总额	-	-	-192,848,570.78	-192,848,570.78
(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)	-45,904,278.78	-	46,591,978.04	687,699.26
其中:1.基金申购款	514,302,888.75	-	359,847,247.34	874,150,136.09
2.基金赎回款	-560,207,167.53	-	-313,255,269.30	-873,462,436.83
(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)	335,576,804.15	-	172,774,137.11	508,350,941.26
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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)	100,162,131.71	-	39,194,995.42	139,357,127.13
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)	100,162,131.71	-	39,194,995.42	139,357,127.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	281,318,951.22	-	279,835,734.43	561,154,685.65
(一)、综合收益总额	-	-	72,670,568.84	72,670,568.84
(二)、本期基	281,318,951.22	-	207,165,165.59	488,484,116.81

金份额 交易产生 的基金净 值变动数 (净值减 少以“-” 号填列)				
其中:1. 基金申 购款	493,938,059.34	-	352,687,038.00	846,625,097.34
2 .基金赎 回款	-212,619,108.12	-	-145,521,872.41	-358,140,980.53
(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)	381,481,082.93	-	319,030,729.85	700,511,812.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城量化小盘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[2017]第 2169 号《关于准予景顺长城量化小盘股票型证券投资基金注册的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,783,703,963.03 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(2018)第 0090 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,784,551,427.10 份基金份额,其中认购资金利息折合 847,464.07 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化小盘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,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债等)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规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)。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 80-95%,投资于小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%,除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-20%,每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需要缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府证券不低于基金净资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率 X95%+银行活期存款利率(税后)X5%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2023 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 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》、本基金基金合同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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、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以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损

益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本

基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资

产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《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》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》(财会[2022]14号)，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度可比期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下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，金额分别为 82,491,581.55 元、4,201,935.28 元、130,491.44 元、6,603.93 元和 1,917,503.64 元。新金融工具准则下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、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 82,496,198.85 元、4,203,826.18 元、130,550.14 元、0.00 元和 1,917,503.64 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 652,780,759.73 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 652,780,796.76 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 34,080,529.04 元、2,978,264.43 元、846,890.40 元、141,148.38 元、2,788,434.36 元和 6,793.97 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 34,080,529.04 元、2,978,264.43 元、846,890.40 元、141,148.38 元、2,788,434.36 元和 6,793.97 元。

于 2021 年 12 月 31 日，“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”、“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，根据新金融工具准则下的计量类别，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”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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》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。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	29,280,457.86	82,491,581.55
等于：本金	29,277,382.48	82,491,581.55
加：应计利息	3,075.38	-
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	29,280,457.86	82,491,581.55

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	509,172,733.15	-	479,660,016.70	-29,512,716.45
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	509,172,733.15	-	479,660,016.70	-29,512,716.45
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	642,341,687.77	-	652,422,359.73	10,080,671.96
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	256,000.00	358,400.00	102,400.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	256,000.00	358,400.00	102,400.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	642,597,687.77	-	652,780,759.73	10,183,071.96

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末的衍生金融资产/负债余额为零。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末的买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	6,603.93
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	6,603.93

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5,613.07	6,793.97
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,221,240.45	2,788,434.36
其中：交易所市场	2,221,240.45	2,788,434.36
银行间市场	-	-

应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	175,000.00
合计	2,406,853.52	2,970,228.33

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	381,481,082.93	381,481,082.93
本期申购	514,302,888.75	514,302,888.75
本期赎回（以“-”号填列）	-560,207,167.53	-560,207,167.53
本期末	335,576,804.15	335,576,804.15

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	350,962,218.64	-31,931,488.79	319,030,729.85
本期利润	-153,152,782.37	-39,695,788.41	-192,848,570.78
本期基金份额交易产生的变动数	15,332,876.57	31,259,101.47	46,591,978.04
其中：基金申购款	419,565,042.63	-59,717,795.29	359,847,247.34
基金赎回款	-404,232,166.06	90,976,896.76	-313,255,269.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	213,142,312.84	-40,368,175.73	172,774,137.11

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
	活期存款利息收入	195,079.58
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	83,711.53	33,739.24
其他	5,089.48	832.08
合计	283,880.59	122,907.78

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-151,352,807.91	71,512,323.10
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	-151,352,807.91	71,512,323.10

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	7,145,310,740.95	2,628,515,814.92
减：卖出股票成本总额	7,274,983,003.69	2,557,003,491.82
减：交易费用	21,680,545.17	-
买卖股票差价收入	-151,352,807.91	71,512,323.10

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	729.52	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	670,770.64	100,656.65
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	671,500.16	100,656.65

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券 到期兑付）成交总额	3,356,179.18	514,340.84
减：卖出债券（债转股及 债券到期兑付）成本总额	2,684,500.00	413,500.00
减：应计利息总额	788.40	184.19
减：交易费用	120.14	-
买卖债券差价收入	670,770.64	100,656.65

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日

股票投资产生的股利收益	9,095,302.64	2,250,939.99
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	9,095,302.64	2,250,939.99

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-39,695,788.41	11,945,865.01
股票投资	-39,593,388.41	11,843,465.01
债券投资	-102,400.00	102,400.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-39,695,788.41	11,945,865.01

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	1,374,002.73	1,092,985.05
基金转换费收入	701,445.00	75,566.03
合计	2,075,447.73	1,168,551.08

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
审计费用	60,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00

证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	8,246.82	9,383.25
其他	360.00	360.00
交易费用	-	8,467,586.41
合计	188,606.82	8,652,329.66

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)
长城证券	186,643,089.90	1.31	75,280,696.07	1.33

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日

	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
长城证券	173,815.23	1.31	173,815.23	7.83
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
长城证券	70,107.94	1.33	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,774,996.71	4,953,051.66
其中：支付销售机构的客户维护费	3,117,570.45	1,628,013.02

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,962,499.45	825,508.62

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

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

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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转融通证券出借业务交易。

7.4.10.4.2 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转融通证券出借业务交易。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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均未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期	29,280,457.86	195,079.58	82,491,581.55	88,336.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301095	广立	2022	6个月	新股流	58.00	86.49	703	40,774.00	60,802.47	-

	微	年 7 月 28 日		通受限							
301115	建科 股份	2022 年 8 月 23 日	6 个月	新股流 通受限	42.05	24.04	685	28,804.25	16,467.40	-	
301132	满坤 科技	2022 年 8 月 3 日	6 个月	新股流 通受限	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-	
301139	元道 通信	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股流 通受限	38.46	25.31	566	21,768.36	14,325.46	-	
301152	天力 锂能	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股流 通受限	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-	
301161	唯万 密封	2022 年 9 月 6 日	6 个月	新股流 通受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-	
301165	锐捷 网络	2022 年 11 月 14 日	6 个月	新股流 通受限	32.38	31.61	780	25,256.40	24,655.80	-	
301171	易点 天下	2022 年 8 月 10 日	6 个月	新股流 通受限	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-	
301176	逸豪 新材	2022 年 9 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-	
301195	北路 智控	2022 年 7 月 25 日	6 个月	新股流 通受限	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-	
301197	工大 科雅	2022 年 7 月 29 日	6 个月	新股流 通受限	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-	
301231	荣信 文化	2022 年 8 月 31 日	6 个月	新股流 通受限	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-	
301233	盛帮 股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股流 通受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-	
301239	普瑞 眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股流 通受限	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-	
301265	华新 环保	2022 年 12	6 个月	新股流 通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-	

		月 8 日								
301267	华夏眼科	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股流通受限	50.88	66.20	578	29,408.64	38,263.60	-
301269	华大九天	2022 年 7 月 21 日	6 个月	新股流通受限	32.69	87.94	801	26,184.69	70,439.94	-
301270	汉仪股份	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股流通受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301282	金禄电子	2022 年 8 月 18 日	6 个月	新股流通受限	30.38	25.25	434	13,184.92	10,958.50	-
301283	聚胶股份	2022 年 8 月 26 日	6 个月	新股流通受限	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301285	鸿日达	2022 年 9 月 21 日	6 个月	新股流通受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301290	东星医疗	2022 年 11 月 23 日	6 个月	新股流通受限	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	-
301296	新巨丰	2022 年 8 月 26 日	6 个月	新股流通受限	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-
301297	富乐德	2022 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-
301300	远翔新材	2022 年 8 月 9 日	6 个月	新股流通受限	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股流通受限	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22	-
301306	西测测试	2022 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301308	江波龙	2022 年 7 月 27 日	6 个月	新股流通受限	55.67	56.72	819	45,593.73	46,453.68	-

301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301327	华宝新能	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301330	熵基科技	2022年8月10日	6个月	新股流通受限	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14	-
301338	凯格精机	2022年8月8日	6个月	新股流通受限	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301339	通行宝	2022年9月2日	6个月	新股流通受限	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67	-
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60	-
301359	东南电子	2022年11月2日	6个月	新股流通受限	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301361	众智科技	2022年11月8日	6个月	新股流通受限	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32	-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301367	怡和	2022	6个月	新股流	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94	-

	嘉业	年 10 月 21 日		通受限							
301368	丰立智能	2022 年 12 月 7 日	6 个月	新股流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-	
301377	鼎泰高科	2022 年 11 月 11 日	6 个月	新股流通受限	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-	
301388	欣灵电气	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股流通受限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-	
301396	宏景科技	2022 年 11 月 4 日	6 个月	新股流通受限	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40	-	
301398	星源卓镁	2022 年 12 月 8 日	6 个月	新股流通受限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-	
600459	贵研铂业	2022 年 12 月 22 日	1 个月内(含)	配股流通受限	10.91	15.74	93,348	1,018,426.68	1,469,297.52	-	
688273	麦澜德	2022 年 8 月 4 日	6 个月	新股流通受限	40.29	31.52	3,568	143,754.72	112,463.36	-	
688353	华盛锂电	2022 年 7 月 6 日	6 个月	新股流通受限	98.35	63.86	3,758	369,599.30	239,985.88	-	
688362	甬矽电子	2022 年 11 月 9 日	6 个月	新股流通受限	18.54	19.18	7,779	144,222.66	149,201.22	-	
688381	帝奥微	2022 年 8 月 15 日	6 个月	新股流通受限	41.68	37.98	6,897	287,466.96	261,948.06	-	
688525	佰维存储	2022 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	13.99	15.27	4,614	64,549.86	70,455.78	-	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末，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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金未持有除国债、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（上年度末：0.05%）。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12。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 个工作日内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 个工作日内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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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							
银行存款	29,280,457.86	-	-	-	-	-	29,280,457.86
结算备付金	2,485,449.52	-	-	-	-	-	2,485,449.52
存出保证金	316,290.19	-	-	-	-	-	316,290.19
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-479,660,016.70	479,660,016.70
应收申购款	-	-	-	-	-	166,612.93	166,612.93
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,765,276.40	3,765,276.40
资产总计	32,082,197.57	-	-	-	-	-483,591,906.03	515,674,103.60
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,106,948.22	1,106,948.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	702,986.93	702,986.93

应付托管费	-	-	-	-	-	117,164.47	117,164.47
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,989,206.15	2,989,206.15
应交税费	-	-	-	-	-	3.05	3.05
其他负债	-	-	-	-	-	2,406,853.52	2,406,853.52
负债总计	-	-	-	-	-	7,323,162.34	7,323,162.34
利率敏感度缺口	32,082,197.57	-	-	-	-	-	-
上年度末 2021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							
银行存款	82,491,581.55	-	-	-	-	-	82,491,581.55
结算备付金	4,201,935.28	-	-	-	-	-	4,201,935.28
存出保证金	130,491.44	-	-	-	-	-	130,491.44
交易性金融资产	-	-	-	-358,400.00	652,422,359.73	652,780,759.73	
应收申购款	-	-	-	-	-	1,917,503.64	1,917,503.64
其他资产	-	-	-	-	-	6,603.93	6,603.93
资产总计	86,824,008.27	-	-	-358,400.00	654,346,467.30	741,528,875.57	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,978,264.43	2,978,264.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	846,890.40	846,890.40
应付托管费	-	-	-	-	-	141,148.38	141,148.38
应付证券清算款	-	-	-	-	-	34,080,529.04	34,080,529.04
应交税费	-	-	-	-	-	2.21	2.21
其他负债	-	-	-	-	-	2,970,228.33	2,970,228.33
负债总计	-	-	-	-	-	41,017,062.79	41,017,062.79
利率敏感度缺口	86,824,008.27	-	-	-358,400.00	-	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.00%（上年度末：0.05%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	479,660,016.70	94.36	652,422,359.73	93.14
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	479,660,016.70	94.36	652,422,359.73	93.14

7.4.13.4.3.2 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		
	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12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	14,084,582.58	23,250,104.75
	沪深 300 指数下降 5%	-14,084,582.58	-23,250,104.75

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	476,525,479.19	651,172,570.96
第二层次	1,469,297.52	1,608,188.77
第三层次	1,665,239.99	-
合计	479,660,016.70	652,780,759.73

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,806,556.46	1,806,556.46
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-141,316.47	-141,316.47

其中：计入损益的利得或损失	-	-141,316.47	-141,316.47
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,665,239.99	1,665,239.99
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-141,316.47	-141,316.47
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2022 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

限售股票	1,665,239.99	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.1891-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	479,660,016.70	93.02
	其中：股票	479,660,016.70	93.02
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	31,765,907.38	6.16
8	其他各项资产	4,248,179.52	0.82
9	合计	515,674,103.60	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	6,000,600.00	1.18
B	采矿业	14,310,768.00	2.82
C	制造业	343,192,564.89	67.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,092,090.60	2.18
E	建筑业	11,615,470.00	2.28
F	批发和零售业	13,376,309.00	2.63
G	交通运输、仓储和邮政业	2,269,472.00	0.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,091,400.02	7.69
J	金融业	7,679,224.96	1.51
K	房地产业	10,135,180.00	1.99
L	租赁和商务服务业	6,815,152.65	1.34
M	科学研究和技术服务业	6,699,169.48	1.32
N	水利、环境和公共设施管理业	2,407,032.00	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	280,312.60	0.06
R	文化、体育和娱乐业	4,695,270.50	0.92
S	综合	-	-
	合计	479,660,016.70	94.36

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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	002258	利尔化学	529,395	9,507,934.20	1.87
2	002597	金禾实业	290,900	9,454,250.00	1.86
3	300352	北信源	2,303,364	9,397,725.12	1.85
4	000517	荣安地产	2,530,800	7,465,860.00	1.47
5	300639	凯普生物	441,050	7,431,692.50	1.46
6	600284	浦东建设	1,040,000	7,009,600.00	1.38
7	002662	京威股份	2,102,600	6,917,554.00	1.36
8	300900	广联航空	238,700	6,857,851.00	1.35
9	600210	紫江企业	1,368,500	6,842,500.00	1.35
10	002649	博彦科技	659,700	6,788,313.00	1.34
11	601908	京运通	963,672	6,331,325.04	1.25

12	600481	双良节能	482,200	6,239,668.00	1.23
13	300761	立华股份	175,200	6,000,600.00	1.18
14	002697	红旗连锁	1,059,700	5,966,111.00	1.17
15	600971	恒源煤电	830,600	5,947,096.00	1.17
16	002276	万马股份	709,500	5,853,375.00	1.15
17	600559	老白干酒	212,200	5,841,866.00	1.15
18	000758	中色股份	1,211,700	5,755,575.00	1.13
19	000915	华特达因	124,011	5,642,500.50	1.11
20	300502	新易盛	237,200	5,633,500.00	1.11
21	300377	赢时胜	668,400	5,487,564.00	1.08
22	002261	拓维信息	811,300	5,378,919.00	1.06
23	002036	联创电子	426,100	5,270,857.00	1.04
24	600057	厦门象屿	505,195	5,188,352.65	1.02
25	600285	羚锐制药	396,558	5,171,116.32	1.02
26	600073	上海梅林	647,000	5,143,650.00	1.01
27	600330	天通股份	486,500	5,127,710.00	1.01
28	300438	鹏辉能源	65,100	5,077,149.00	1.00
29	300401	花园生物	347,700	5,003,403.00	0.98
30	000913	钱江摩托	267,700	4,947,096.00	0.97
31	002517	恺英网络	702,700	4,609,712.00	0.91
32	000917	电广传媒	871,800	4,515,924.00	0.89
33	600993	马应龙	197,900	4,472,540.00	0.88
34	002020	京新药业	366,800	4,467,624.00	0.88
35	603108	润达医疗	427,700	4,324,047.00	0.85
36	603612	索通发展	159,900	4,160,598.00	0.82
37	002463	沪电股份	348,030	4,141,557.00	0.81
38	002610	爱康科技	1,440,500	4,105,425.00	0.81
39	000933	神火股份	273,500	4,091,560.00	0.80
40	000791	甘肃电投	766,020	4,044,585.60	0.80
41	300457	赢合科技	228,210	4,032,470.70	0.79
42	000030	富奥股份	911,742	4,011,664.80	0.79
43	600750	江中药业	276,500	3,995,425.00	0.79
44	300101	振芯科技	162,000	3,969,000.00	0.78
45	603118	共进股份	489,300	3,889,935.00	0.77
46	002100	天康生物	466,500	3,876,615.00	0.76
47	600305	恒顺醋业	310,800	3,825,948.00	0.75
48	002291	遥望科技	287,300	3,734,900.00	0.73
49	002085	万丰奥威	600,900	3,575,355.00	0.70
50	002158	汉钟精机	148,700	3,561,365.00	0.70
51	300130	新国都	291,880	3,522,991.60	0.69
52	300910	瑞丰新材	28,300	3,489,673.00	0.69
53	600612	老凤祥	79,600	3,406,880.00	0.67
54	603690	至纯科技	89,400	3,382,896.00	0.67

55	600158	中体产业	387,000	3,378,510.00	0.66
56	600742	一汽富维	396,800	3,317,248.00	0.65
57	000049	德赛电池	75,400	3,278,392.00	0.64
58	000600	建投能源	610,100	3,203,025.00	0.63
59	000612	焦作万方	604,501	3,155,495.22	0.62
60	002324	普利特	196,000	3,136,000.00	0.62
61	603368	柳药集团	165,300	3,086,151.00	0.61
62	603129	春风动力	27,300	3,071,796.00	0.60
63	601375	中原证券	837,800	3,049,592.00	0.60
64	002055	得润电子	334,600	2,884,252.00	0.57
65	002967	广电计量	171,400	2,876,092.00	0.57
66	600963	岳阳林纸	525,400	2,863,430.00	0.56
67	603959	百利科技	267,000	2,822,190.00	0.56
68	002139	拓邦股份	272,100	2,821,677.00	0.56
69	300775	三角防务	73,800	2,804,400.00	0.55
70	688559	海目星	48,400	2,799,456.00	0.55
71	002733	雄韬股份	162,800	2,792,020.00	0.55
72	603960	克来机电	153,410	2,719,959.30	0.54
73	300119	瑞普生物	145,500	2,707,755.00	0.53
74	688556	高测股份	36,000	2,700,720.00	0.53
75	300634	彩讯股份	175,300	2,673,325.00	0.53
76	300725	药石科技	33,100	2,664,550.00	0.52
77	000560	我爱我家	1,050,700	2,626,750.00	0.52
78	688233	神工股份	62,934	2,567,707.20	0.51
79	688598	金博股份	11,680	2,563,526.40	0.50
80	600685	中船防务	120,400	2,499,504.00	0.49
81	601069	西部黄金	207,300	2,464,797.00	0.48
82	300567	精测电子	48,500	2,434,700.00	0.48
83	688148	芳源股份	166,604	2,430,752.36	0.48
84	000546	金圆股份	198,600	2,407,032.00	0.47
85	600389	江山股份	52,200	2,300,976.00	0.45
86	688516	奥特维	11,354	2,282,154.00	0.45
87	603601	再升科技	425,500	2,246,640.00	0.44
88	603920	世运电路	156,200	2,246,156.00	0.44
89	002839	张家港行	481,800	2,221,098.00	0.44
90	300224	正海磁材	176,500	2,211,545.00	0.44
91	000921	海信家电	162,600	2,141,442.00	0.42
92	600459	贵研铂业	133,207	2,096,678.18	0.41
93	688037	芯源微	13,292	2,080,198.00	0.41
94	601567	三星医疗	152,327	2,053,367.96	0.40
95	002182	云海金属	93,670	1,976,437.00	0.39
96	300666	江丰电子	28,474	1,970,400.80	0.39
97	002768	国恩股份	67,200	1,950,144.00	0.38

98	600572	康恩贝	405,400	1,917,542.00	0.38
99	600063	皖维高新	321,500	1,880,775.00	0.37
100	688707	振华新材	40,900	1,838,455.00	0.36
101	688778	厦钨新能	23,000	1,786,640.00	0.35
102	600502	安徽建工	371,600	1,783,680.00	0.35
103	002518	科士达	30,100	1,733,760.00	0.34
104	300394	天孚通信	68,000	1,723,800.00	0.34
105	002222	福晶科技	108,100	1,710,142.00	0.34
106	300842	帝科股份	33,100	1,701,009.00	0.33
107	688202	美迪西	7,712	1,649,519.68	0.32
108	600869	远东股份	323,700	1,634,685.00	0.32
109	003021	兆威机电	33,900	1,629,573.00	0.32
110	300662	科锐国际	33,200	1,626,800.00	0.32
111	002378	章源钨业	229,200	1,613,568.00	0.32
112	600211	西藏药业	44,700	1,605,624.00	0.32
113	601137	博威合金	106,100	1,571,341.00	0.31
114	301039	中集车辆	195,700	1,559,729.00	0.31
115	600105	永鼎股份	442,600	1,509,266.00	0.30
116	002807	江阴银行	378,768	1,503,708.96	0.30
117	603906	龙蟠科技	63,900	1,479,285.00	0.29
118	300777	中简科技	29,800	1,464,670.00	0.29
119	600098	广州发展	263,000	1,459,650.00	0.29
120	002446	盛路通信	152,200	1,455,032.00	0.29
121	300748	金力永磁	48,100	1,407,406.00	0.28
122	301047	义翘神州	14,110	1,406,202.60	0.28
123	688733	壹石通	37,300	1,405,091.00	0.28
124	603105	芯能科技	93,100	1,371,363.00	0.27
125	688399	硕世生物	14,986	1,314,422.06	0.26
126	300860	锋尚文化	25,200	1,311,156.00	0.26
127	688518	联赢激光	43,693	1,276,272.53	0.25
128	603328	依顿电子	195,800	1,270,742.00	0.25
129	603529	爱玛科技	27,600	1,266,012.00	0.25
130	600995	南网储能	85,100	1,227,142.00	0.24
131	600720	祁连山	122,500	1,216,425.00	0.24
132	600888	新疆众和	147,700	1,209,663.00	0.24
133	300185	通裕重工	487,500	1,170,000.00	0.23
134	002402	和而泰	78,900	1,150,362.00	0.23
135	605009	豪悦护理	21,800	1,130,766.00	0.22
136	600428	中远海特	179,500	1,069,820.00	0.21
137	601126	四方股份	68,500	1,000,100.00	0.20
138	002432	九安医疗	19,200	981,312.00	0.19
139	000795	英洛华	148,900	966,361.00	0.19
140	688139	海尔生物	14,311	905,886.30	0.18

141	688800	瑞可达	8,200	874,776.00	0.17
142	300382	斯莱克	46,100	870,368.00	0.17
143	000567	海德股份	61,700	858,864.00	0.17
144	000810	创维数字	61,400	855,916.00	0.17
145	300219	鸿利智汇	111,250	743,150.00	0.15
146	600761	安徽合力	56,000	736,400.00	0.14
147	000767	晋控电力	214,000	725,460.00	0.14
148	000860	顺鑫农业	24,000	715,680.00	0.14
149	601975	招商南油	169,300	667,042.00	0.13
150	688578	艾力斯	33,104	651,486.72	0.13
151	688019	安集科技	3,538	636,840.00	0.13
152	300035	中科电气	30,700	631,806.00	0.12
153	002865	钧达股份	3,400	629,340.00	0.12
154	600206	有研新材	48,200	618,888.00	0.12
155	603301	振德医疗	14,900	566,945.00	0.11
156	600478	科力远	59,200	555,296.00	0.11
157	600575	淮河能源	221,000	532,610.00	0.10
158	300222	科大智能	81,983	520,592.05	0.10
159	002567	唐人神	71,000	502,680.00	0.10
160	688131	皓元医药	4,400	476,872.00	0.09
161	600872	中炬高新	12,200	449,814.00	0.09
162	300068	南都电源	20,900	445,170.00	0.09
163	600821	金开新能	59,700	432,228.00	0.09
164	000423	东阿阿胶	10,400	423,280.00	0.08
165	002130	沃尔核材	62,400	402,480.00	0.08
166	600496	精工钢构	90,900	359,055.00	0.07
167	603299	苏盐井神	35,700	355,929.00	0.07
168	600420	国药现代	37,500	341,250.00	0.07
169	688085	三友医疗	11,400	316,350.00	0.06
170	300236	上海新阳	10,800	300,132.00	0.06
171	600586	金晶科技	34,100	297,011.00	0.06
172	300607	拓斯达	18,100	263,355.00	0.05
173	688381	帝奥微	6,897	261,948.06	0.05
174	600645	中源协和	14,700	250,047.00	0.05
175	688353	华盛锂电	3,758	239,985.88	0.05
176	000059	华锦股份	31,500	214,200.00	0.04
177	301060	兰卫医学	10,300	201,983.00	0.04
178	600172	黄河旋风	37,500	181,500.00	0.04
179	300080	易成新能	34,300	159,838.00	0.03
180	688362	甬矽电子	7,779	149,201.22	0.03
181	600508	上海能源	10,000	143,300.00	0.03
182	600587	新华医疗	6,100	130,662.00	0.03
183	300079	数码视讯	24,300	116,397.00	0.02

184	688273	麦澜德	3,568	112,463.36	0.02
185	300827	上能电气	1,672	98,380.48	0.02
186	300393	中来股份	5,600	82,992.00	0.02
187	688525	佰维存储	4,614	70,455.78	0.01
188	301269	华大九天	801	70,439.94	0.01
189	688575	亚辉龙	3,300	64,845.00	0.01
190	301095	广立微	703	60,802.47	0.01
191	688278	特宝生物	1,516	59,017.88	0.01
192	600811	东方集团	20,500	50,020.00	0.01
193	301308	江波龙	819	46,453.68	0.01
194	603323	苏农银行	9,800	45,962.00	0.01
195	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.01
196	000718	苏宁环球	12,900	42,570.00	0.01
197	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.01
198	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.01
199	301267	华夏眼科	578	38,263.60	0.01
200	002746	仙坛股份	3,400	31,144.00	0.01
201	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.01
202	301165	锐捷网络	780	24,655.80	0.00
203	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
204	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
205	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
206	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
207	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
208	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
209	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
210	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
211	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
212	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
213	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
214	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
215	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
216	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
217	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
218	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
219	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
220	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
221	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
222	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
223	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
224	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
225	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
226	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00

227	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
228	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
229	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
230	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
231	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
232	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
233	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
234	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
235	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
236	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
237	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
238	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
239	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
240	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
241	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
242	605507	国邦医药	100	2,647.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002276	万马股份	63,028,112.05	9.00
2	300457	赢合科技	59,246,378.08	8.46
3	300170	汉得信息	57,450,637.75	8.20
4	603236	移远通信	54,412,682.60	7.77
5	600273	嘉化能源	54,292,499.00	7.75
6	600929	雪天盐业	53,599,186.67	7.65
7	002649	博彦科技	51,905,313.95	7.41
8	002258	利尔化学	51,735,057.05	7.39
9	000682	东方电子	51,608,468.00	7.37
10	300775	三角防务	49,063,328.10	7.00
11	688516	奥特维	48,123,121.43	6.87
12	601666	平煤股份	46,917,750.06	6.70
13	002850	科达利	46,644,630.78	6.66
14	300401	花园生物	46,210,889.90	6.60
15	000933	神火股份	45,182,016.00	6.45
16	002344	海宁皮城	44,791,416.00	6.39
17	300378	鼎捷软件	44,587,438.02	6.36
18	002573	清新环境	44,280,547.69	6.32
19	002063	远光软件	43,961,562.52	6.28
20	300373	扬杰科技	43,031,696.57	6.14
21	000915	华特达因	42,086,969.42	6.01
22	688388	嘉元科技	41,523,321.98	5.93

23	600662	外服控股	41,487,778.99	5.92
24	300639	凯普生物	41,476,793.16	5.92
25	300662	科锐国际	40,804,642.00	5.82
26	300327	中颖电子	39,247,902.58	5.60
27	300224	正海磁材	38,964,785.00	5.56
28	600057	厦门象屿	38,492,427.00	5.49
29	002662	京威股份	36,524,079.73	5.21
30	600481	双良节能	36,421,804.00	5.20
31	600123	兰花科创	35,387,269.00	5.05
32	600285	羚锐制药	35,147,549.58	5.02
33	601619	嘉泽新能	34,963,118.00	4.99
34	000543	皖能电力	34,895,164.00	4.98
35	300352	北信源	34,806,834.60	4.97
36	600389	江山股份	34,222,083.00	4.89
37	600971	恒源煤电	33,364,531.40	4.76
38	000567	海德股份	33,084,446.23	4.72
39	603599	广信股份	32,850,778.72	4.69
40	300634	彩讯股份	32,794,309.65	4.68
41	603212	赛伍技术	31,910,162.64	4.56
42	300118	东方日升	31,814,832.00	4.54
43	300171	东富龙	31,585,643.15	4.51
44	603305	旭升集团	31,381,087.99	4.48
45	300696	爱乐达	30,828,996.88	4.40
46	002182	云海金属	29,819,988.70	4.26
47	603612	索通发展	29,739,648.80	4.25
48	300226	上海钢联	29,585,740.26	4.22
49	300803	指南针	29,474,631.00	4.21
50	002597	金禾实业	29,414,689.00	4.20
51	600452	涪陵电力	29,091,897.53	4.15
52	002582	好想你	29,015,963.00	4.14
53	002738	中矿资源	29,013,252.92	4.14
54	002291	遥望科技	28,869,987.47	4.12
55	603383	顶点软件	28,639,606.31	4.09
56	002497	雅化集团	28,476,932.98	4.07
57	002091	江苏国泰	28,403,827.55	4.05
58	300390	天华超净	28,390,184.80	4.05
59	688399	硕世生物	28,204,552.26	4.03
60	300861	美畅股份	28,178,568.63	4.02
61	600596	新安股份	28,085,532.94	4.01
62	600330	天通股份	27,677,181.80	3.95
63	605168	三人行	27,593,211.79	3.94
64	601677	明泰铝业	26,959,453.80	3.85
65	300769	德方纳米	26,942,031.50	3.85

66	601330	绿色动力	26,883,061.00	3.84
67	300395	菲利华	26,355,775.50	3.76
68	300143	盈康生命	26,291,129.00	3.75
69	300900	广联航空	26,019,782.00	3.71
70	300035	中科电气	26,010,558.35	3.71
71	300709	精研科技	25,924,309.80	3.70
72	300573	兴齐眼药	25,827,121.00	3.69
73	002539	云图控股	25,789,553.00	3.68
74	002446	盛路通信	25,277,641.00	3.61
75	002042	华孚时尚	24,825,386.00	3.54
76	688508	芯朋微	24,705,582.74	3.53
77	600639	浦东金桥	24,564,277.52	3.51
78	300130	新国都	24,538,599.00	3.50
79	300073	当升科技	24,315,757.13	3.47
80	300432	富临精工	24,285,369.28	3.47
81	002463	沪电股份	23,703,254.90	3.38
82	002085	万丰奥威	23,377,969.00	3.34
83	300666	江丰电子	23,261,051.27	3.32
84	002436	兴森科技	23,210,242.00	3.31
85	600750	江中药业	23,064,411.20	3.29
86	002839	张家港行	23,040,767.00	3.29
87	600360	华微电子	22,764,526.20	3.25
88	002929	润建股份	22,657,122.80	3.23
89	603180	金牌厨柜	22,416,335.88	3.20
90	300083	创世纪	22,337,452.00	3.19
91	002267	陕天然气	22,312,910.47	3.19
92	000762	西藏矿业	22,229,397.24	3.17
93	000823	超声电子	22,190,159.92	3.17
94	603688	石英股份	22,037,727.00	3.15
95	002768	国恩股份	21,865,136.55	3.12
96	688598	金博股份	21,725,727.34	3.10
97	600825	新华传媒	21,654,571.00	3.09
98	688298	东方生物	21,575,069.68	3.08
99	002041	登海种业	21,573,133.00	3.08
100	300748	金力永磁	21,439,496.00	3.06
101	300409	道氏技术	21,142,485.00	3.02
102	600105	永鼎股份	21,116,543.00	3.01
103	600129	太极集团	21,047,500.00	3.00
104	300087	荃银高科	20,805,980.25	2.97
105	000848	承德露露	20,798,634.50	2.97
106	600557	康缘药业	20,679,278.40	2.95
107	002518	科士达	20,539,493.76	2.93
108	002192	融捷股份	20,296,193.16	2.90

109	002043	兔宝宝	20,278,020.00	2.89
110	600882	妙可蓝多	20,169,229.00	2.88
111	002982	湘佳股份	20,049,835.00	2.86
112	002262	恩华药业	20,033,126.00	2.86
113	600428	中远海特	19,977,053.13	2.85
114	300765	新诺威	19,927,561.41	2.84
115	000657	中钨高新	19,881,427.81	2.84
116	603610	麒盛科技	19,874,451.00	2.84
117	603387	基蛋生物	19,770,711.49	2.82
118	300319	麦捷科技	19,725,204.20	2.82
119	600223	鲁商发展	19,586,817.50	2.80
120	600710	苏美达	19,412,210.56	2.77
121	300770	新媒股份	19,347,125.30	2.76
122	688033	天宜上佳	19,337,263.68	2.76
123	600206	有研新材	19,276,918.80	2.75
124	300252	金信诺	19,135,405.20	2.73
125	603979	金诚信	19,134,013.39	2.73
126	603018	华设集团	19,128,760.05	2.73
127	603920	世运电路	18,985,457.07	2.71
128	300684	中石科技	18,817,845.79	2.69
129	300036	超图软件	18,798,703.06	2.68
130	603609	禾丰股份	18,769,251.00	2.68
131	002955	鸿合科技	18,719,007.30	2.67
132	300233	金城医药	18,715,569.00	2.67
133	603005	晶方科技	18,658,182.84	2.66
134	600559	老白干酒	18,511,468.50	2.64
135	002158	汉钟精机	18,383,557.18	2.62
136	600797	浙大网新	18,342,462.00	2.62
137	600565	迪马股份	18,171,784.00	2.59
138	002807	江阴银行	18,131,118.28	2.59
139	000758	中色股份	18,010,379.00	2.57
140	300394	天孚通信	17,923,215.00	2.56
141	300477	合纵科技	17,891,706.58	2.55
142	603896	寿仙谷	17,747,359.13	2.53
143	600295	鄂尔多斯	17,705,974.00	2.53
144	600063	皖维高新	17,632,291.60	2.52
145	600363	联创光电	17,530,635.00	2.50
146	000498	山东路桥	17,462,910.00	2.49
147	300604	长川科技	17,289,341.00	2.47
148	603108	润达医疗	17,242,676.68	2.46
149	000034	神州数码	17,219,597.39	2.46
150	603283	赛腾股份	17,161,614.00	2.45
151	600017	日照港	17,132,449.00	2.45

152	600395	盘江股份	17,069,145.00	2.44
153	300762	上海瀚讯	16,984,881.80	2.42
154	688066	航天宏图	16,888,675.03	2.41
155	002449	国星光电	16,840,468.80	2.40
156	000667	美好置业	16,810,226.00	2.40
157	601158	重庆水务	16,737,564.00	2.39
158	300735	光弘科技	16,694,280.00	2.38
159	300346	南大光电	16,640,725.99	2.38
160	603666	亿嘉和	16,528,891.40	2.36
161	603187	海容冷链	16,475,417.55	2.35
162	600366	宁波韵升	16,435,193.38	2.35
163	600496	精工钢构	16,373,458.25	2.34
164	603368	柳药集团	16,136,665.26	2.30
165	002643	万润股份	16,132,959.50	2.30
166	002611	东方精工	16,013,461.00	2.29
167	000902	新洋丰	15,989,039.00	2.28
168	300633	开立医疗	15,713,278.72	2.24
169	002756	永兴材料	15,659,495.28	2.24
170	600108	亚盛集团	15,587,504.52	2.23
171	688233	神工股份	15,440,944.86	2.20
172	000652	泰达股份	15,404,563.20	2.20
173	002413	雷科防务	15,302,244.00	2.18
174	300755	华致酒行	15,299,882.64	2.18
175	300183	东软载波	15,181,589.00	2.17
176	002832	比音勒芬	15,144,482.00	2.16
177	688200	华峰测控	15,110,554.26	2.16
178	002891	中宠股份	15,099,790.50	2.16
179	603718	海利生物	14,943,092.00	2.13
180	000935	四川双马	14,902,348.08	2.13
181	002254	泰和新材	14,837,500.25	2.12
182	601588	北辰实业	14,686,996.00	2.10
183	300438	鹏辉能源	14,479,486.50	2.07
184	002484	江海股份	14,465,612.00	2.07
185	603060	国检集团	14,435,019.40	2.06
186	300860	锋尚文化	14,316,646.13	2.04
187	600499	科达制造	14,303,120.00	2.04
188	600502	安徽建工	14,299,932.03	2.04
189	300294	博雅生物	14,211,009.00	2.03
190	601882	海天精工	14,076,925.00	2.01

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。

8.4.2 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(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	603236	移远通信	58,919,066.91	8.41
2	002276	万马股份	57,052,640.03	8.14
3	300170	汉得信息	56,244,164.47	8.03
4	600273	嘉化能源	55,547,786.92	7.93
5	601666	平煤股份	54,207,709.90	7.74
6	002850	科达利	53,218,173.93	7.60
7	600929	雪天盐业	51,710,355.73	7.38
8	000933	神火股份	51,478,781.84	7.35
9	688516	奥特维	49,974,020.07	7.13
10	000682	东方电子	49,192,177.42	7.02
11	002649	博彦科技	49,008,343.77	7.00
12	300457	赢合科技	48,959,881.38	6.99
13	300775	三角防务	48,844,495.61	6.97
14	300327	中颖电子	46,848,277.58	6.69
15	002344	海宁皮城	45,662,514.67	6.52
16	300378	鼎捷软件	45,408,625.24	6.48
17	600662	外服控股	43,450,882.20	6.20
18	300401	花园生物	42,966,431.94	6.13
19	600057	厦门象屿	42,962,441.73	6.13
20	002573	清新环境	42,693,358.13	6.09
21	603599	广信股份	41,324,893.98	5.90
22	688388	嘉元科技	41,004,810.67	5.85
23	300373	扬杰科技	40,852,667.85	5.83
24	600123	兰花科创	40,815,648.00	5.83
25	002738	中矿资源	40,135,315.97	5.73
26	002258	利尔化学	39,381,389.00	5.62
27	002063	远光软件	39,302,547.11	5.61
28	000915	华特达因	38,874,056.35	5.55
29	600389	江山股份	38,637,310.38	5.52
30	000543	皖能电力	37,183,234.00	5.31
31	300639	凯普生物	36,636,252.70	5.23
32	300224	正海磁材	36,174,939.00	5.16
33	300662	科锐国际	35,581,573.40	5.08
34	600285	羚锐制药	35,580,283.32	5.08
35	601619	嘉泽新能	34,895,250.00	4.98
36	300118	东方日升	34,085,937.96	4.87
37	603305	旭升集团	33,983,661.86	4.85
38	300696	爱乐达	33,822,891.34	4.83
39	000567	海德股份	33,488,183.63	4.78
40	300803	指南针	32,606,903.43	4.65
41	600596	新安股份	32,561,227.68	4.65
42	300390	天华超净	32,269,276.00	4.61

43	603383	顶点软件	32,237,011.32	4.60
44	688399	硕世生物	32,075,942.94	4.58
45	300634	彩讯股份	31,957,596.64	4.56
46	603612	索通发展	31,843,230.93	4.55
47	300395	菲利华	31,414,412.30	4.48
48	300769	德方纳米	31,167,476.20	4.45
49	300171	东富龙	30,964,843.91	4.42
50	600452	涪陵电力	30,812,541.26	4.40
51	603212	赛伍技术	30,618,735.10	4.37
52	600971	恒源煤电	30,151,917.26	4.30
53	300226	上海钢联	30,128,857.88	4.30
54	002497	雅化集团	29,998,743.34	4.28
55	600481	双良节能	29,467,127.00	4.21
56	002662	京威股份	29,192,528.45	4.17
57	300143	盈康生命	29,141,013.00	4.16
58	002182	云海金属	29,002,956.69	4.14
59	002042	华孚时尚	28,684,277.00	4.09
60	601677	明泰铝业	28,305,673.58	4.04
61	300035	中科电气	27,845,540.24	3.98
62	300573	兴齐眼药	27,726,497.05	3.96
63	300709	精研科技	27,594,973.63	3.94
64	605168	三人行	27,549,048.89	3.93
65	600360	华微电子	27,233,713.20	3.89
66	002436	兴森科技	27,075,747.79	3.87
67	002839	张家港行	26,927,893.30	3.84
68	300666	江丰电子	26,586,501.82	3.80
69	002043	兔宝宝	26,439,154.25	3.77
70	002446	盛路通信	26,383,612.95	3.77
71	002929	润建股份	26,143,909.15	3.73
72	002449	国星光电	26,057,265.35	3.72
73	002539	云图控股	26,049,429.55	3.72
74	300073	当升科技	26,009,016.00	3.71
75	600882	妙可蓝多	25,882,686.00	3.69
76	002582	好想你	25,718,567.42	3.67
77	603610	麒盛科技	25,452,140.85	3.63
78	002091	江苏国泰	25,257,086.56	3.61
79	600330	天通股份	24,789,874.80	3.54
80	688298	东方生物	24,718,902.20	3.53
81	002597	金禾实业	24,603,956.00	3.51
82	300770	新媒股份	24,437,605.75	3.49
83	300432	富临精工	24,402,783.50	3.48
84	600710	苏美达	24,370,751.76	3.48
85	600108	亚盛集团	24,347,306.98	3.48

86	300861	美畅股份	24,262,889.13	3.46
87	600557	康缘药业	24,240,982.74	3.46
88	000823	超声电子	24,193,197.00	3.45
89	002291	遥望科技	24,137,434.55	3.45
90	300352	北信源	24,046,399.00	3.43
91	002267	陕天然气	24,039,425.98	3.43
92	603688	石英股份	24,005,567.76	3.43
93	000498	山东路桥	23,740,332.00	3.39
94	601330	绿色动力	23,540,014.61	3.36
95	000667	美好置业	23,504,954.00	3.36
96	300409	道氏技术	23,222,616.07	3.32
97	600116	三峡水利	23,199,281.00	3.31
98	600502	安徽建工	23,026,729.60	3.29
99	688508	芯朋微	22,738,159.90	3.25
100	002254	泰和新材	22,611,766.21	3.23
101	600639	浦东金桥	22,505,527.54	3.21
102	688033	天宜上佳	22,371,954.42	3.19
103	002085	万丰奥威	22,370,783.00	3.19
104	600206	有研新材	21,886,810.84	3.12
105	300083	创世纪	21,840,152.00	3.12
106	002041	登海种业	21,748,807.82	3.10
107	000652	泰达股份	21,704,307.19	3.10
108	688066	航天宏图	21,693,818.56	3.10
109	300130	新国都	21,489,903.85	3.07
110	600797	浙大网新	21,410,751.00	3.06
111	688598	金博股份	21,356,979.95	3.05
112	300900	广联航空	21,245,941.18	3.03
113	603979	金诚信	21,165,259.92	3.02
114	002768	国恩股份	21,070,094.68	3.01
115	002518	科士达	21,058,486.00	3.01
116	600825	新华传媒	20,940,716.77	2.99
117	600223	鲁商发展	20,919,929.00	2.99
118	000762	西藏矿业	20,852,079.00	2.98
119	300087	荃银高科	20,830,863.55	2.97
120	002192	融捷股份	20,733,567.55	2.96
121	600363	联创光电	20,711,633.13	2.96
122	600428	中远海特	20,685,899.00	2.95
123	000848	承德露露	20,610,149.22	2.94
124	688200	华峰测控	20,491,512.77	2.93
125	002982	湘佳股份	20,482,493.47	2.92
126	603387	基蛋生物	19,950,750.20	2.85
127	300765	新诺威	19,609,532.11	2.80
128	300294	博雅生物	19,607,771.00	2.80

129	603666	亿嘉和	19,494,083.60	2.78
130	603005	晶方科技	19,424,858.47	2.77
131	002955	鸿合科技	19,361,801.61	2.76
132	600295	鄂尔多斯	19,302,142.72	2.76
133	300735	光弘科技	19,277,670.56	2.75
134	300233	金城医药	19,244,545.42	2.75
135	002643	万润股份	19,084,851.00	2.72
136	603609	禾丰股份	18,979,883.99	2.71
137	002158	汉钟精机	18,974,292.00	2.71
138	002463	沪电股份	18,973,896.92	2.71
139	300346	南大光电	18,968,837.60	2.71
140	300477	合纵科技	18,924,139.56	2.70
141	600129	太极集团	18,911,876.00	2.70
142	603018	华设集团	18,730,780.80	2.67
143	002407	多氟多	18,650,215.00	2.66
144	688122	西部超导	18,627,446.84	2.66
145	300684	中石科技	18,526,592.67	2.64
146	300604	长川科技	18,408,043.57	2.63
147	300036	超图软件	18,192,615.36	2.60
148	300319	麦捷科技	18,121,043.00	2.59
149	600496	精工钢构	17,963,275.48	2.56
150	002611	东方精工	17,607,341.51	2.51
151	600395	盘江股份	17,577,752.31	2.51
152	002262	恩华药业	17,512,264.00	2.50
153	000034	神州数码	17,440,407.00	2.49
154	300379	东方通	17,420,559.73	2.49
155	002891	中宠股份	17,411,263.00	2.49
156	300748	金力永磁	17,369,693.97	2.48
157	300252	金信诺	17,271,314.80	2.47
158	603180	金牌厨柜	17,248,711.82	2.46
159	600105	永鼎股份	17,248,006.00	2.46
160	688030	山石网科	17,217,851.96	2.46
161	300394	天孚通信	17,211,309.59	2.46
162	600565	迪马股份	17,206,382.00	2.46
163	600017	日照港	17,200,438.00	2.46
164	600750	江中药业	17,199,087.00	2.46
165	601588	北辰实业	17,178,520.00	2.45
166	000657	中钨高新	16,738,446.89	2.39
167	002413	雷科防务	16,702,778.00	2.38
168	603896	寿仙谷	16,577,647.40	2.37
169	601158	重庆水务	16,368,821.00	2.34
170	002807	江阴银行	16,069,817.00	2.29
171	601001	晋控煤业	15,939,619.36	2.28

172	600063	皖维高新	15,920,541.00	2.27
173	300633	开立医疗	15,825,901.88	2.26
174	301031	中熔电气	15,803,101.00	2.26
175	603920	世运电路	15,341,167.00	2.19
176	000065	北方国际	15,337,382.85	2.19
177	002832	比音勒芬	15,278,019.40	2.18
178	603043	广州酒家	15,253,182.73	2.18
179	002756	永兴材料	15,235,039.20	2.17
180	000935	四川双马	15,105,624.45	2.16
181	603187	海容冷链	14,810,185.65	2.11
182	002585	双星新材	14,650,747.00	2.09
183	603368	柳药集团	14,556,874.30	2.08
184	300762	上海瀚讯	14,553,400.91	2.08
185	600559	老白干酒	14,481,402.00	2.07
186	600366	宁波韵升	14,420,790.00	2.06
187	601882	海天精工	14,375,900.00	2.05
188	603718	海利生物	14,335,747.00	2.05
189	300183	东软载波	14,317,497.04	2.04
190	600810	神马股份	14,236,835.00	2.03
191	300302	同有科技	14,072,103.58	2.01
192	300653	正海生物	14,060,519.72	2.01

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。

8.4.3 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	7,141,814,049.07
卖出股票收入（成交）总额	7,145,310,740.95

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

安徽金禾实业股份有限公司（以下简称“金禾实业”，股票代码：002597）于 2022 年 12 月 27 日收到滁州市应急管理局下达的《行政处罚决定书》（滁）应急罚[2022]7-8 号，其因未能认真履行法定安全生产主体责任、组织开展工艺和装置的安全风险辨识不到位等多项违法违规行为，被处以罚款 50 万元的行政处罚。

金禾实业于 2022 年 9 月 30 日收到滁州市生态环境局出具的《行政处罚决定书》，其因污染排放、其他环境违规等违法违规行为，被处以罚款 74.76 万元的行政处罚。

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金禾实业进行了投资。

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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	316,290.19
2	应收清算款	3,765,276.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	166,612.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,248,179.52

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
96,059	3,493.44	131,265,253.65	39.12	204,311,550.50	60.88

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	71,231.21	0.021226

9.3 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

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研发部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 2 月 6 日）基金份额总额	1,784,551,427.10
本报告期期初基金份额总额	381,481,082.93
本报告期基金总申购份额	514,302,888.75
减：本报告期基金总赎回份额	560,207,167.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	335,576,804.15

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：

本基金管理人于 2022 年 12 月 6 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任康乐先生担任本公司财务负责人。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 5 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 60,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
广发证券股份有限公司	1	1,905,430,759.39	13.37	1,774,523.34	13.37	-
中信证券股份有限公司	4	1,560,969,734.68	10.95	1,453,749.18	10.95	-
中泰证券股份有限公司	2	1,360,935,671.59	9.55	1,267,439.52	9.55	-
光大证券股份有限公司	2	1,246,845,260.68	8.75	1,161,209.12	8.75	-
中信建投证券股份有限公司	2	1,231,376,694.65	8.64	1,146,796.91	8.64	-
国泰君安证券股份有限公司	1	1,112,789,118.48	7.81	1,036,345.18	7.81	-
西部证券股份有限公司	2	1,001,880,313.71	7.03	933,058.70	7.03	-
渤海证券股份有限公司	1	820,665,935.57	5.76	764,296.08	5.76	-
华创证券有限责任公司	1	634,794,465.90	4.45	591,174.17	4.45	-
国信证券	2	445,940,461.86	3.13	415,313.28	3.13	-

股份有限 公司						
天风证券 股份有限 公司	1	422,868,954.48	2.97	393,825.41	2.97	-
东方财富 证券股份 有限公司	2	421,869,410.20	2.96	392,884.99	2.96	-
东北证券 股份有限 公司	1	368,429,897.50	2.58	343,125.47	2.58	-
中银国际 证券股份 有限公司	1	359,763,939.77	2.52	335,052.74	2.52	-
方正证券 股份有限 公司	1	303,248,251.74	2.13	282,415.87	2.13	-
东方证券 股份有限 公司	1	297,910,829.31	2.09	277,447.12	2.09	-
安信证券 股份有限 公司	1	219,615,453.46	1.54	204,537.28	1.54	-
长城证券 股份有限 公司	2	186,643,089.90	1.31	173,815.23	1.31	-
华金证券 股份有限 公司	2	174,646,075.40	1.23	162,648.87	1.23	本期 新增
长江证券 股份有限 公司	1	109,048,655.30	0.77	101,558.17	0.77	-
汇丰前海 证券有限 责任公司	1	68,133,355.96	0.48	63,453.47	0.48	-
招商证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、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。

11.7.2 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 (%)
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1,804,448.89	53.76	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	182,045.64	5.42	-	-	-	-
中信建投证券股份有	-	-	-	-	-	-

限公司						
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	353,500.79	10.53	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	321,412.50	9.58	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	694,771.36	20.70	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 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公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022年1月1日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022年1月1日
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022年1月1日
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2022 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022年1月1日

5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富证券为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 1 月 7 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	2022 年 1 月 7 日
7	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	2022 年 1 月 20 日
8	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 1 月 24 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 1 月 24 日
10	关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 1 月 25 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于投资旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 1 月 27 日
12	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	2022 年 2 月 18 日
13	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	2022 年 2 月 25 日
14	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	2022 年 3 月 4 日
15	关于旗下部分基金参加西部证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 3 月 10 日
16	关于旗下部分基金新增东方证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 3 月 24 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 3 月 28 日
18	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 3 月 28 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司和北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 1 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机升级的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 8 日
21	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	2022 年 4 月 12 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2022 年 4 月 16 日

	停机维护的公告	网站	
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司招赢通平台为销售平台并开通转换业务及参加基金申购费率、转换费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 20 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和讯科技为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 21 日
25	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	2022 年 4 月 22 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 22 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 22 日
28	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 22 日
29	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	2022 年 4 月 29 日
30	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	2022 年 5 月 6 日
31	关于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	2022 年 5 月 12 日
32	关于旗下部分基金新增攀赢基金为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 5 月 26 日
33	景顺长城基金管理有限公司关于暂停腾元基金、汇付基金、南京途牛和有鱼基金办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 5 月 26 日
34	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2022 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 5 月 27 日
35	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 5 月 27 日
36	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	2022 年 6 月 10 日
37	关于旗下部分基金参加申万宏源证券和申万宏源西部证券基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 6 月 22 日

38	关于旗下部分基金新增华泰证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 6 月 23 日
39	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信百信银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 6 月 23 日
40	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	2022 年 6 月 24 日
41	景顺长城基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 7 月 12 日
42	关于旗下部分基金新增五矿证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 7 月 14 日
43	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	2022 年 7 月 15 日
44	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 7 月 21 日
45	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 7 月 21 日
46	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	2022 年 7 月 29 日
47	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加长城证券基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 8 月 3 日
48	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	2022 年 8 月 6 日
49	景顺长城基金管理有限公司关于开通交通银行借记卡直销网上交易业务及费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 8 月 25 日
50	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 8 月 26 日
51	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机升级的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 8 月 27 日
52	关于网络平台冒用“景顺长城基金”及员工名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 8 月 31 日
53	景顺长城量化小盘股票型证券投资基	中国证监会指定报刊及	2022 年 8 月 31 日

	金 2022 年中期报告	网站	
54	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 8 月 31 日
55	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	2022 年 9 月 2 日
56	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增博时财富为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 9 月 7 日
57	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	2022 年 9 月 9 日
58	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	2022 年 9 月 16 日
59	景顺长城基金管理有限公司关于公司固有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 10 月 18 日
60	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 10 月 26 日
61	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 10 月 26 日
62	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	2022 年 10 月 31 日
63	景顺长城基金管理有限公司关于暂停武汉市伯嘉基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 10 月 31 日
64	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	2022 年 11 月 5 日
65	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	2022 年 11 月 18 日
66	关于旗下部分基金新增厦门银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 11 月 21 日
67	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 11 月 22 日
68	关于景顺长城量化小盘股票型证券投资基金新增国信证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 11 月 23 日
69	景顺长城基金管理有限公司关于基金	中国证监会指定报刊及	2022 年 12 月 6 日

	行业高级管理人员（财务负责人）变更公告	网站	
70	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	2022 年 12 月 16 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220622-20221017; 20221215-20221231	0.00	118,466,735.01	48,060,647.89	70,406,087.12	20.98

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况,可能会出现如下风险:

1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时,如本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。

2、如面临大额赎回的情况,可能导致以下风险:

- (1) 基金在短期内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;
- (2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;
- (3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;
- (4) 因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;
- (5) 基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;
- (6) 大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止和化解上述风险,最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前,请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

- 4、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 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

2023 年 3 月 28 日