

# 景顺长城量化精选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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
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	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
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	14
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	14
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>16</b>
7.1 资产负债表	16
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	21

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	49
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 .....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.12 投资组合报告附注 .....	62
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>63</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
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 .....	63
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 .....	63
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>63</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>64</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
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 .....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4 基金投资策略的改变 .....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
11.8 其他重大事件 .....	67
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>71</b>
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 .....	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>71</b>
13.1 备查文件目录 .....	71
13.2 存放地点 .....	71
13.3 查阅方式 .....	71

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化精选股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城量化精选股票
场内简称	无
基金主代码	000978
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 4 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	456,489,143.72 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型精选股票，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略：本基金股票资产占基金资产的比例范围为 80%-95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略：本基金主要采用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 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	本基金是一只股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	王小飞
	联系电话	0755-82370388	021-60637103
	电子邮箱	investor@igwfm.com	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	证券时报
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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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	-101,404,961.22	130,101,780.04	336,195,700.26
本期利润	-136,343,017.41	121,207,838.45	282,210,311.96
加权平均基金份额本期利润	-0.3211	0.2620	0.3455
本期加权平均净值利润率	-18.17%	14.02%	25.40%
本期基金份额净值增长率	-16.84%	21.06%	28.59%
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	287,658,215.06	416,581,992.04	221,513,656.14
期末可供分配基金份额利润	0.6302	0.9599	0.6189
期末基金资产净值	744,147,358.78	850,554,415.00	579,410,437.58
期末基金份额净值	1.630	1.960	1.619
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	69.79%	104.16%	68.64%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计

入基金资产。

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

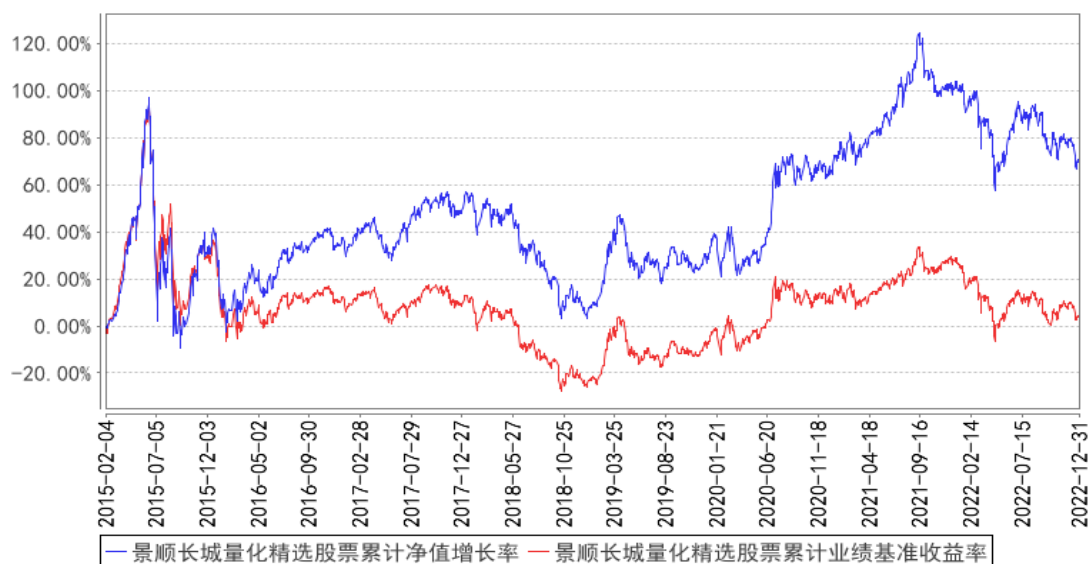
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.09%	0.97%	2.52%	0.97%	-5.61%	0.00%
过去六个月	-11.61%	1.03%	-8.66%	1.04%	-2.95%	-0.01%
过去一年	-16.84%	1.28%	-19.30%	1.31%	2.46%	-0.03%
过去三年	29.47%	1.29%	11.15%	1.28%	18.32%	0.01%
过去五年	13.27%	1.34%	-5.25%	1.34%	18.52%	0.00%
自基金合同生效起至今	69.79%	1.72%	4.11%	1.59%	65.68%	0.13%

### 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

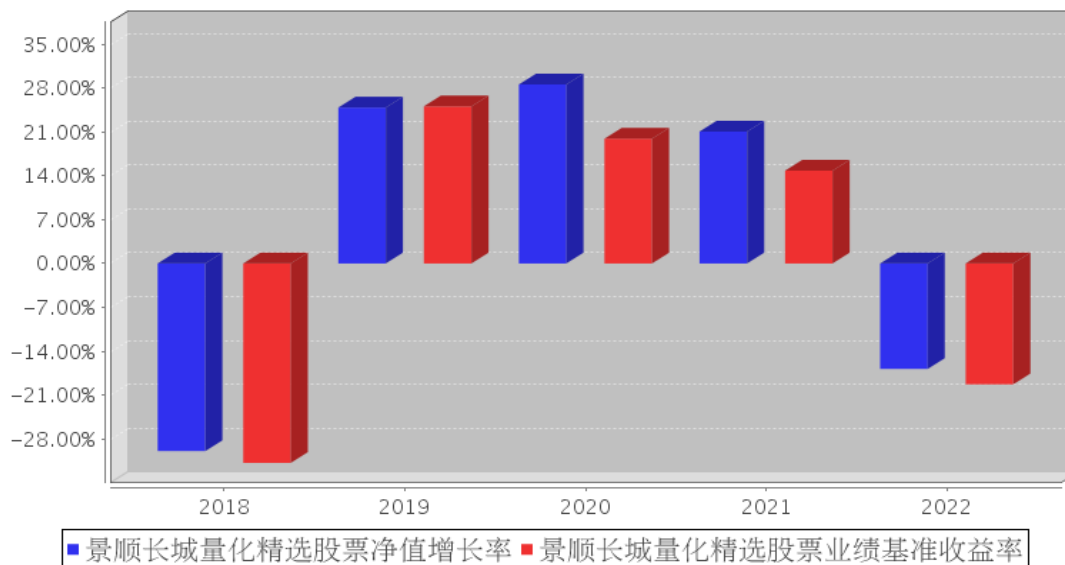
景顺长城量化精选股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例范围为 80%–95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%–20%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为 0–3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2015 年 2 月 4 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 过去五年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

景顺长城量化精选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



### 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	2015年2月4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、《景顺长城量化精选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-16.84%，业绩比较基准收益率为-19.30%。

## 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。风格上，估值和成长相对均衡的中盘股以及细分行业的龙头股仍然值得期待。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	安永华明（2023）审字第 60467014_H16 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	景顺长城量化精选股票型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了景顺长城量化精选股票型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的景顺长城量化精选股票型证券投资基

	<p>金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了景顺长城量化精选股票型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。</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。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精选股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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>
其他信息	<p>景顺长城量化精选股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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，管理层负责评估景顺长城量化精选股票型证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督景顺长城量化精选股票型证券投资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>(1) 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</p>

	<p>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>(2) 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>(3) 评价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>(4) 对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，就可能对导致对景顺长城量化精选股票型证券投资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精选股票型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	昌华 黄拥璇
会计师事务所的地址	中国 北京
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：景顺长城量化精选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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	44,256,450.26	55,663,743.61
结算备付金		5,105,701.07	9,254,955.75
存出保证金		220,398.55	2,345,506.42
交易性金融资产	7.4.7.2	700,276,377.87	789,511,983.40
其中：股票投资		700,276,377.87	789,382,983.40
基金投资		-	-
债券投资		-	129,000.00
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		325,434.60	352,378.41
应收股利		-	-
应收申购款		333,312.48	345,020.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	9,851.80
资产总计		750,517,674.83	857,483,440.37
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,107,767.77	884,871.42
应付管理人报酬		946,024.56	1,134,797.99
应付托管费		157,670.79	189,133.00
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.14	47,450.64
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	4,158,852.79	4,672,772.32
负债合计		6,370,316.05	6,929,025.37
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	456,489,143.72	433,972,422.96
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	287,658,215.06	416,581,992.04
净资产合计		744,147,358.78	850,554,415.00
负债和净资产总计		750,517,674.83	857,483,440.37

注：（1）报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.630 元，基金份额总额 456,489,143.72 份。

（2）以下比较数据已根据本年《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》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 7.2 利润表

会计主体：景顺长城量化精选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 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
<b>一、营业总收入</b>		-123,010,361.15	155,691,689.17
1. 利息收入		263,667.28	805,317.63
其中：存款利息收入	7.4.7.13	263,667.28	518,120.96
债券利息收入		-	287,196.67
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）		-88,811,533.45	161,881,176.78
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-99,970,375.68	138,734,233.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	1,156,961.34	458,135.71
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	-190,528.59	9,034,900.87
股利收益	7.4.7.19	10,192,409.48	13,653,906.81
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	-34,938,963.67	-8,896,029.27
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	476,468.69	1,901,224.03

<b>减：二、营业总支出</b>		13,332,656.26	34,483,850.72
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	11,237,312.38	12,989,290.80
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,872,885.48	2,164,881.81
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		-902.30	30,438.75
8. 其他费用	7.4.7.23	223,360.70	19,299,239.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-136,343,017.41	121,207,838.45
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-136,343,017.41	121,207,838.45
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-136,343,017.41	121,207,838.45

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城量化精选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、上期期末净资产（基金净值）	433,972,422.96	-	416,581,992.04	850,554,415.00
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）	433,972,422.96	-	416,581,992.04	850,554,415.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	22,516,720.76	-	-128,923,776.98	-106,407,056.22

(一)、综合收益总额	-	-	-136,343,017.41	-136,343,017.41
(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)	22,516,720.76	-	7,419,240.43	29,935,961.19
其中: 1. 基金申购款	178,571,168.75	-	130,879,235.54	309,450,404.29
2. 基金赎回款	-156,054,447.99	-	-123,459,995.11	-279,514,443.10
(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)	456,489,143.72	-	287,658,215.06	744,147,358.78
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)	357,896,781.44	-	221,513,656.14	579,410,437.58
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)	357,896,781.44	-	221,513,656.14	579,410,437.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	76,075,641.52	-	195,068,335.90	271,143,977.42
(一)、综合收益总额	-	-	121,207,838.45	121,207,838.45
(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)	76,075,641.52	-	73,860,497.45	149,936,138.97
其中: 1. 基金申购款	574,382,146.66	-	510,559,042.37	1,084,941,189.03
2. 基金赎回款	-498,306,505.14	-	-436,698,544.92	-935,005,050.06
(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)	433,972,422.96	-	416,581,992.04	850,554,415.00

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：

<u>康乐</u>	<u>吴建军</u>	<u>邵媛媛</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

景顺长城量化精选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2014]1366 号文《关于准予景顺长城量化精选股票型证券投资基金注册的批复》的核准，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《景顺长城量化精选股票型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2015 年 2 月 4 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,407,431,598.88 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 442,601.36 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,407,874,200.24 元，折合 1,407,874,200.24 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，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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（含中小企业私募债）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 80%-95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-20%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为 0-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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

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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### （2）金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期

工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 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，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该

部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的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的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。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及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

本基金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

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 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

根据《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《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）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 55,663,743.61 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 5,735.66 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 55,669,479.27 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 9,254,955.75 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 3,960.78 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 9,258,916.53 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,345,506.42 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 135.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,345,641.42 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 9,851.80 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 5,735.66 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 3,960.78 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 135.00 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 20.36 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 789,511,983.40 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 20.36 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 789,512,003.76 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 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

##### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## （2）增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

## （3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业

费附加的单位外) 及地方教育费附加。

#### (4) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金(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、债券的差价收入, 继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 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, 暂不征收企业所得税。

#### (5) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定, 自 2008 年 10 月 9 日起, 对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定, 自 2013 年 1 月 1 日起, 证券投资基金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, 暂减按 25% 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;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定, 自 2015 年 9 月 8 日起, 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 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	44,256,450.26	55,663,743.61
等于：本金	44,251,835.35	55,663,743.61
加：应计利息	4,614.91	-
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	44,256,450.26	55,663,743.61

## 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	732,937,421.81	-	700,276,377.87	-32,661,043.94
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	732,937,421.81	-	700,276,377.87	-32,661,043.94
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	787,357,141.34	-	789,382,983.40	2,025,842.06
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	129,000.00	129,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	129,000.00	-	129,000.00
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	787,486,141.34	-	789,511,983.40	2,025,842.06

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2021年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	14,611,600.00	-	-	-
其中：股指期货 投资	14,611,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	14,611,600.00	-	-	-

#### 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的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	-	9,851.80
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	9,851.80

**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	4,970.90	1,010.53
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	3,949,381.89	4,447,261.79
其中：交易所市场	3,949,381.89	4,447,261.79
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	204,500.00	224,500.00
合计	4,158,852.79	4,672,772.32

**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	433,972,422.96	433,972,422.96
本期申购	178,571,168.75	178,571,168.75
本期赎回（以“-”号填列）	-156,054,447.99	-156,054,447.99
本期末	456,489,143.72	456,489,143.72

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	520,735,060.01	-104,153,067.97	416,581,992.04
本期利润	-101,404,961.22	-34,938,056.19	-136,343,017.41
本期基金份额交易产生的变动数	12,513,118.39	-5,093,877.96	7,419,240.43
其中：基金申购款	176,321,083.37	-45,441,847.83	130,879,235.54
基金赎回款	-163,807,964.98	40,347,969.87	-123,459,995.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	431,843,217.18	-144,185,002.12	287,658,215.06

**7.4.7.13 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	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
活期存款利息收入	170,073.65	200,487.66
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	89,245.88	314,345.64
其他	4,347.75	3,287.66
合计	263,667.28	518,120.96

**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	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
股票投资收益——买卖股票差价收入	-99,970,375.68	138,734,233.39
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	-99,970,375.68	138,734,233.39

#### 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	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
卖出股票成交总额	7,082,671,480.29	6,184,058,226.93
减：卖出股票成本总额	7,161,136,755.04	6,045,323,993.54
减：交易费用	21,505,100.93	-
买卖股票差价收入	-99,970,375.68	138,734,233.39

#### 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	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
债券投资收益——利息收入	1,725.37	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,155,235.97	458,135.71
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	1,156,961.34	458,135.71

##### 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	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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,876,179.44	22,303,594.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,719,000.00	21,339,240.00
减：应计利息总额	1,788.95	506,218.59
减：交易费用	154.52	-

买卖债券差价收入	1,155,235.97	458,135.71
----------	--------------	------------

#### 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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日
股指期货投资收益	-190,528.59	9,034,900.87

#### 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	10,192,409.48	13,653,906.81
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	10,192,409.48	13,653,906.81

#### 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	-34,686,886.00	-8,316,118.68

股票投资	-34,686,886.00	-8,271,358.68
债券投资	-	-44,760.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-259,640.00	-597,307.91
权证投资	-	-
期货投资	-259,640.00	-597,307.91
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-7,562.33	-17,397.32
合计	-34,938,963.67	-8,896,029.27

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	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
基金赎回费收入	470,147.56	1,652,675.28
基金转换费收入	6,321.13	248,548.75
合计	476,468.69	1,901,224.03

#### 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	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
审计费用	80,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行划款手续费	4,820.44	16,775.88
其他	360.00	360.00
存托服务费	180.26	-
交易费用	-	19,044,103.48
合计	223,360.70	19,299,239.36

### 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，本基金无需作披露的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要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：以下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	549,993,527.89	3.89	214,932,469.30	1.72

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 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	512,208.84	3.89	512,208.84	12.97
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	200,168.59	1.72	-	-

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	11,237,312.38	12,989,290.80
其中：支付销售机构的客户维护费	3,718,548.63	3,397,378.42

注：基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。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

### 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	1,872,885.48	2,164,881.81

注：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

### 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固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 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	44,256,450.26	170,073.65	55,663,743.61	200,487.66

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，并按银行间同业利率计息。

#### 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

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

#### 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	广立微	2022年7月28日	6个月	新股流通受限	58.00	86.49	661	38,338.00	57,169.89	-
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	901	29,174.38	28,480.61	-



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月8日	6个月	新股流通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	50.88	66.20	635	32,308.80	42,037.00	-
301269	华大九天	2022年7月21日	6个月	新股流通受限	32.69	87.94	739	24,157.91	64,987.66	-
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	170	23,609.60	17,598.40	-
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	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94	-
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	-
688041	海光信息	2022年8月5日	6个月	新股流通受限	36.00	39.15	17,097	615,492.00	669,347.55	-

688053	思科瑞	2022 年 7 月 1 日	6 个月	新股流通受限	55.53	60.92	4,865	270,153.45	296,375.80	-
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	-
688376	美埃科技	2022 年 11 月 10 日	6 个月	新股流通受限	29.19	28.49	3,713	108,382.47	105,783.37	-
688480	赛恩斯	2022 年 11 月 18 日	6 个月	新股流通受限	19.18	20.19	2,302	44,152.36	46,477.38	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

### 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：0.02%）。

### 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期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公司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 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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	44,256,450.26	-	-	-	-	-	44,256,450.26
结算备付金	5,105,701.07	-	-	-	-	-	5,105,701.07
存出保证金	220,398.55	-	-	-	-	-	220,398.55

交易性金融资产	-	-	-	-	-	700,276,377.87	700,276,377.87
应收申购款	-	-	-	-	-	333,312.48	333,312.48
应收证券清算款	-	-	-	-	-	325,434.60	325,434.60
资产总计	49,582,549.88	-	-	-	-	700,935,124.95	750,517,674.83
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,107,767.77	1,107,767.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	946,024.56	946,024.56
应付托管费	-	-	-	-	-	157,670.79	157,670.79
应交税费	-	-	-	-	-	0.14	0.14
其他负债	-	-	-	-	-	4,158,852.79	4,158,852.79
负债总计	-	-	-	-	-	6,370,316.05	6,370,316.05
利率敏感度缺口	49,582,549.88	-	-	-	-	-	-
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	55,663,743.61	-	-	-	-	-	55,663,743.61
结算备付金	9,254,955.75	-	-	-	-	-	9,254,955.75
存出保证金	299,882.42	-	-	-	-	2,045,624.00	2,345,506.42
交易性金融资产	-	-	-	-	129,000.00	789,382,983.40	789,511,983.40
应收申购款	-	-	-	-	-	345,020.98	345,020.98
应收证券清算款	-	-	-	-	-	352,378.41	352,378.41
其他资产	-	-	-	-	-	9,851.80	9,851.80
资产总计	65,218,581.78	-	-	-	129,000.00	792,135,858.59	857,483,440.37
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	884,871.42	884,871.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,134,797.99	1,134,797.99
应付托管费	-	-	-	-	-	189,133.00	189,133.00
应交税费	-	-	-	-	-	47,450.64	47,450.64
其他负债	-	-	-	-	-	4,672,772.32	4,672,772.32
负债总计	-	-	-	-	-	6,929,025.37	6,929,025.37
利率敏感度缺口	65,218,581.78	-	-	-	129,000.00	-	-

#### 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：0.02%），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	700,276,377.87	94.10	789,382,983.40	92.81
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	700,276,377.87	94.10	789,382,983.40	92.81

#### 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%	21,494,788.03	26,336,167.26
	沪深 300 指数下降 5%	-21,494,788.03	-26,336,167.26

#### 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	698,180,528.71	786,214,781.05
第二层次	-	3,297,202.35
第三层次	2,095,849.16	-
合计	700,276,377.87	789,511,983.40

## 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

## 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	-	1,980,332.46	1,980,332.46
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	115,516.70	115,516.70
其中：计入损益的利得或损失	-	115,516.70	115,516.70
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,095,849.16	2,095,849.16
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	-	115,516.70	115,516.70
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	-	-	-

#### 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	2,095,849.16	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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 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	700,276,377.87	93.31
	其中：股票	700,276,377.87	93.31
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	49,362,151.33	6.58
8	其他各项资产	879,145.63	0.12
9	合计	750,517,674.83	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	10,460,090.00	1.41
B	采矿业	39,188,916.00	5.27
C	制造业	407,341,164.41	54.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,412,266.36	3.68
E	建筑业	18,021,267.00	2.42
F	批发和零售业	29,686,291.80	3.99
G	交通运输、仓储和邮政业	8,831,117.00	1.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,107,237.04	4.45
J	金融业	64,420,160.77	8.66
K	房地产业	24,409,314.30	3.28
L	租赁和商务服务业	5,116,368.00	0.69
M	科学研究和技术服务业	10,016,704.40	1.35
N	水利、环境和公共设施管理业	10,066,679.49	1.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	82,103.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	9,192,513.30	1.24
S	综合	2,924,185.00	0.39
	合计	700,276,377.87	94.10

**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	601128	常熟银行	2,210,291	16,687,697.05	2.24
2	601555	东吴证券	2,548,924	16,644,473.72	2.24
3	000738	航发控制	623,100	15,976,284.00	2.15
4	002273	水晶光电	1,340,269	15,801,771.51	2.12
5	601108	财通证券	2,146,000	15,279,520.00	2.05
6	600170	上海建工	5,873,000	15,269,800.00	2.05
7	600567	山鹰国际	5,921,300	14,684,824.00	1.97
8	600998	九州通	1,120,986	14,617,657.44	1.96
9	002738	中矿资源	217,700	14,511,882.00	1.95
10	603026	胜华新材	139,700	12,894,310.00	1.73
11	300861	美畅股份	259,267	12,745,565.72	1.71
12	000027	深圳能源	1,907,776	12,133,455.36	1.63
13	600901	江苏租赁	2,153,400	11,800,632.00	1.59
14	002258	利尔化学	647,881	11,635,942.76	1.56
15	000012	南玻 A	1,690,600	11,343,926.00	1.52
16	002192	融捷股份	113,600	11,121,440.00	1.49
17	600256	广汇能源	1,168,400	10,538,968.00	1.42
18	600563	法拉电子	65,753	10,512,589.64	1.41
19	600895	张江高科	924,995	10,489,443.30	1.41
20	002409	雅克科技	193,600	9,751,632.00	1.31
21	300308	中际旭创	359,993	9,730,610.79	1.31
22	002594	比亚迪	37,200	9,559,284.00	1.28
23	603688	石英股份	71,300	9,363,116.00	1.26
24	600549	厦门钨业	468,482	9,158,823.10	1.23
25	600064	南京高科	1,342,800	8,875,908.00	1.19
26	002468	申通快递	854,900	8,831,117.00	1.19
27	601869	长飞光纤	259,800	8,477,274.00	1.14
28	603259	药明康德	103,900	8,415,900.00	1.13
29	601231	环旭电子	505,200	8,199,396.00	1.10
30	600380	健康元	693,100	7,825,099.00	1.05
31	603886	元祖股份	388,539	7,623,135.18	1.02
32	000975	银泰黄金	681,675	7,525,692.00	1.01
33	600827	百联股份	619,228	7,505,043.36	1.01
34	600572	康恩贝	1,578,500	7,466,305.00	1.00
35	002649	博彦科技	716,000	7,367,640.00	0.99
36	603868	飞科电器	108,700	7,318,771.00	0.98
37	002074	国轩高科	251,700	7,256,511.00	0.98

38	600967	内蒙一机	871,600	7,199,416.00	0.97
39	600598	北大荒	501,100	6,895,136.00	0.93
40	601991	大唐发电	2,389,900	6,667,821.00	0.90
41	300390	天华超净	112,000	6,258,560.00	0.84
42	600211	西藏药业	172,600	6,199,792.00	0.83
43	603096	新经典	308,260	6,128,208.80	0.82
44	603185	上机数控	57,140	6,048,269.00	0.81
45	300009	安科生物	617,172	5,776,729.92	0.78
46	300642	透景生命	277,200	5,762,988.00	0.77
47	002049	紫光国微	43,100	5,681,442.00	0.76
48	300115	长盈精密	548,500	5,666,005.00	0.76
49	600863	内蒙华电	1,592,700	5,558,523.00	0.75
50	002085	万丰奥威	913,423	5,434,866.85	0.73
51	601058	赛轮轮胎	529,300	5,303,586.00	0.71
52	600054	黄山旅游	410,600	5,231,044.00	0.70
53	601908	京运通	790,700	5,194,899.00	0.70
54	600582	天地科技	993,600	5,166,720.00	0.69
55	600153	建发股份	377,200	5,148,780.00	0.69
56	600210	紫江企业	1,027,957	5,139,785.00	0.69
57	002391	长青股份	704,300	4,951,229.00	0.67
58	688063	派能科技	15,400	4,861,010.00	0.65
59	300070	碧水源	1,012,507	4,789,158.11	0.64
60	600728	佳都科技	868,600	4,586,208.00	0.62
61	600305	恒顺醋业	370,900	4,565,779.00	0.61
62	002261	拓维信息	671,500	4,452,045.00	0.60
63	600298	安琪酵母	98,400	4,449,648.00	0.60
64	601969	海南矿业	589,700	4,369,677.00	0.59
65	600811	东方集团	1,784,900	4,355,156.00	0.59
66	605369	拱东医疗	40,900	4,319,449.00	0.58
67	688690	纳微科技	81,000	4,193,370.00	0.56
68	600699	均胜电子	298,430	4,192,941.50	0.56
69	300401	花园生物	284,700	4,096,833.00	0.55
70	300058	蓝色光标	797,100	4,025,355.00	0.54
71	000513	丽珠集团	117,800	3,826,144.00	0.51
72	300910	瑞丰新材	30,200	3,723,962.00	0.50
73	002244	滨江集团	417,800	3,689,174.00	0.50
74	688289	圣湘生物	163,700	3,593,215.00	0.48
75	600975	新五丰	501,400	3,564,954.00	0.48
76	002132	恒星科技	782,400	3,473,856.00	0.47
77	603619	中曼石油	190,700	3,419,251.00	0.46
78	002807	江阴银行	856,900	3,401,893.00	0.46
79	300532	今天国际	233,300	3,378,184.00	0.45
80	300207	欣旺达	152,200	3,219,030.00	0.43

81	300144	宋城演艺	209,500	3,058,700.00	0.41
82	300496	中科创达	29,300	2,938,790.00	0.39
83	600673	东阳光	336,500	2,924,185.00	0.39
84	603920	世运电路	201,883	2,903,077.54	0.39
85	603612	索通发展	111,300	2,896,026.00	0.39
86	300450	先导智能	69,600	2,801,400.00	0.38
87	600820	隧道股份	522,100	2,751,467.00	0.37
88	300624	万兴科技	89,000	2,613,040.00	0.35
89	601717	郑煤机	232,100	2,590,236.00	0.35
90	002048	宁波华翔	179,100	2,489,490.00	0.33
91	603369	今世缘	47,500	2,417,750.00	0.32
92	600718	东软集团	235,300	2,341,235.00	0.31
93	000997	新大陆	173,800	2,261,138.00	0.30
94	000729	燕京啤酒	210,300	2,233,386.00	0.30
95	600399	抚顺特钢	155,500	2,225,205.00	0.30
96	601666	平煤股份	204,800	2,213,888.00	0.30
97	002444	巨星科技	116,100	2,203,578.00	0.30
98	300457	赢合科技	100,500	1,775,835.00	0.24
99	300871	回盛生物	86,450	1,763,580.00	0.24
100	002100	天康生物	208,600	1,733,466.00	0.23
101	600307	酒钢宏兴	1,033,400	1,705,110.00	0.23
102	600021	上海电力	169,200	1,693,692.00	0.23
103	600637	东方明珠	252,300	1,677,795.00	0.23
104	605117	德业股份	4,800	1,589,760.00	0.21
105	002570	贝因美	293,000	1,585,130.00	0.21
106	002860	星帅尔	115,400	1,500,200.00	0.20
107	300841	康华生物	17,210	1,456,310.20	0.20
108	605136	丽人丽妆	103,600	1,448,328.00	0.19
109	600089	特变电工	71,300	1,431,704.00	0.19
110	600642	申能股份	247,500	1,358,775.00	0.18
111	600376	首开股份	238,100	1,354,789.00	0.18
112	603127	昭衍新药	21,640	1,263,992.40	0.17
113	689009	九号公司	41,454	1,263,932.46	0.17
114	600570	恒生电子	31,150	1,260,329.00	0.17
115	002865	钧达股份	6,400	1,184,640.00	0.16
116	300639	凯普生物	67,700	1,140,745.00	0.15
117	600160	巨化股份	70,100	1,087,251.00	0.15
118	000415	渤海租赁	490,700	1,084,447.00	0.15
119	600546	山煤国际	66,700	966,483.00	0.13
120	600481	双良节能	73,500	951,090.00	0.13
121	000869	张裕 A	31,200	943,488.00	0.13
122	300258	精锻科技	65,700	764,091.00	0.10
123	000661	长春高新	4,400	732,380.00	0.10

124	600862	中航高科	32,100	715,509.00	0.10
125	002353	杰瑞股份	25,500	711,705.00	0.10
126	688041	海光信息	17,097	669,347.55	0.09
127	603658	安图生物	10,600	655,610.00	0.09
128	002557	洽洽食品	12,900	645,000.00	0.09
129	002497	雅化集团	26,400	613,800.00	0.08
130	002966	苏州银行	75,200	585,056.00	0.08
131	002840	华统股份	33,600	567,504.00	0.08
132	002506	协鑫集成	142,700	415,257.00	0.06
133	002812	恩捷股份	2,600	341,354.00	0.05
134	002756	永兴材料	3,300	304,161.00	0.04
135	002384	东山精密	12,200	301,706.00	0.04
136	688053	思科瑞	4,865	296,375.80	0.04
137	600438	通威股份	7,100	273,918.00	0.04
138	002340	格林美	29,100	216,213.00	0.03
139	603527	众源新材	10,600	149,248.00	0.02
140	688362	甬矽电子	7,779	149,201.22	0.02
141	688376	美埃科技	3,713	105,783.37	0.01
142	301269	华大九天	739	64,987.66	0.01
143	301095	广立微	661	57,169.89	0.01
144	300775	三角防务	1,300	49,400.00	0.01
145	688480	赛恩斯	2,302	46,477.38	0.01
146	301308	江波龙	819	46,453.68	0.01
147	600150	中国船舶	2,000	44,560.00	0.01
148	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.01
149	301267	华夏眼科	635	42,037.00	0.01
150	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.01
151	603113	金能科技	4,400	39,908.00	0.01
152	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.01
153	301165	锐捷网络	901	28,480.61	0.00
154	688122	西部超导	300	28,407.00	0.00
155	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
156	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
157	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
158	000728	国元证券	3,300	20,889.00	0.00
159	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
160	301349	信德新材	170	17,598.40	0.00
161	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
162	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
163	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
164	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
165	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
166	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00

167	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
168	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
169	605123	派克新材	100	13,290.00	0.00
170	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
171	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
172	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
173	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
174	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
175	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
176	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
177	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
178	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
179	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
180	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
181	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
182	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
183	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
184	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
185	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
186	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
187	601828	美凯龙	1,400	6,566.00	0.00
188	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
189	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
190	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
191	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
192	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
193	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
194	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
195	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
196	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
197	301316	慧博云通	359	5,140.88	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	600256	广汇能源	58,250,682.50	6.85
2	600157	永泰能源	45,732,539.00	5.38
3	000728	国元证券	45,680,253.50	5.37
4	000738	航发控制	44,483,835.00	5.23
5	600487	亨通光电	44,012,167.36	5.17
6	300308	中际旭创	42,214,951.36	4.96
7	600153	建发股份	42,123,425.16	4.95
8	600718	东软集团	40,423,274.00	4.75

9	600728	佳都科技	40,093,069.00	4.71
10	603613	国联股份	40,042,472.09	4.71
11	002396	星网锐捷	39,883,539.50	4.69
12	300775	三角防务	39,882,413.00	4.69
13	601128	常熟银行	39,633,397.87	4.66
14	002460	赣锋锂业	38,094,254.44	4.48
15	002468	申通快递	37,165,467.21	4.37
16	600380	健康元	36,911,215.00	4.34
17	002410	广联达	36,394,583.00	4.28
18	002807	江阴银行	35,247,005.80	4.14
19	600901	江苏租赁	34,620,440.00	4.07
20	600885	宏发股份	34,499,606.20	4.06
21	600415	小商品城	33,346,308.00	3.92
22	600170	上海建工	33,147,198.00	3.90
23	300390	天华超净	33,030,997.68	3.88
24	600985	淮北矿业	32,740,627.00	3.85
25	600582	天地科技	32,134,884.88	3.78
26	601555	东吴证券	31,933,484.64	3.75
27	600549	厦门钨业	31,728,253.78	3.73
28	600598	北大荒	31,515,990.20	3.71
29	000686	东北证券	31,030,965.06	3.65
30	002756	永兴材料	31,000,743.92	3.64
31	600089	特变电工	30,936,064.47	3.64
32	600141	兴发集团	30,735,312.59	3.61
33	688099	晶晨股份	30,732,707.24	3.61
34	300138	晨光生物	30,438,353.33	3.58
35	600967	内蒙一机	30,241,062.00	3.56
36	002637	赞宇科技	30,201,563.87	3.55
37	002966	苏州银行	30,128,786.00	3.54
38	601231	环旭电子	29,051,268.50	3.42
39	600662	外服控股	28,878,129.17	3.40
40	600572	康恩贝	28,532,964.37	3.35
41	300457	赢合科技	28,436,738.98	3.34
42	600064	南京高科	27,738,021.17	3.26
43	600325	华发股份	27,630,581.65	3.25
44	600211	西藏药业	27,279,988.40	3.21
45	000552	靖远煤电	27,148,658.76	3.19
46	002649	博彦科技	26,977,499.00	3.17
47	002517	恺英网络	26,933,301.00	3.17
48	600282	南钢股份	26,596,821.77	3.13
49	300696	爱乐达	26,465,731.70	3.11
50	601881	中国银河	26,167,417.13	3.08
51	000970	中科三环	26,152,934.10	3.07

52	300244	迪安诊断	25,779,857.68	3.03
53	002497	雅化集团	25,698,766.61	3.02
54	601958	金钼股份	25,526,083.34	3.00
55	600811	东方集团	25,310,918.00	2.98
56	002258	利尔化学	25,229,030.08	2.97
57	603668	天马科技	25,009,027.16	2.94
58	600808	马钢股份	24,836,698.00	2.92
59	300181	佐力药业	24,798,681.50	2.92
60	002273	水晶光电	24,713,784.28	2.91
61	300861	美畅股份	24,698,703.63	2.90
62	000060	中金岭南	24,686,660.29	2.90
63	300115	长盈精密	24,623,796.02	2.90
64	601668	中国建筑	23,707,947.00	2.79
65	000402	金融街	23,682,867.28	2.78
66	603599	广信股份	23,673,496.00	2.78
67	000598	兴蓉环境	23,659,446.00	2.78
68	603886	元祖股份	23,628,945.19	2.78
69	601098	中南传媒	23,621,321.80	2.78
70	002533	金杯电工	23,438,927.00	2.76
71	603712	七一二	23,319,707.00	2.74
72	002085	万丰奥威	23,314,485.19	2.74
73	300009	安科生物	23,199,430.01	2.73
74	000878	云南铜业	23,110,647.31	2.72
75	600298	安琪酵母	22,943,881.94	2.70
76	600486	扬农化工	22,898,641.60	2.69
77	300073	当升科技	22,764,583.45	2.68
78	002384	东山精密	22,747,485.00	2.67
79	601615	明阳智能	22,676,126.00	2.67
80	002557	洽洽食品	22,372,042.00	2.63
81	603868	飞科电器	22,262,966.88	2.62
82	600566	济川药业	22,203,574.06	2.61
83	600529	山东药玻	22,186,604.48	2.61
84	300750	宁德时代	22,001,229.86	2.59
85	600909	华安证券	21,945,297.50	2.58
86	600970	中材国际	21,930,015.00	2.58
87	600057	厦门象屿	21,721,050.08	2.55
88	603883	老百姓	21,707,726.80	2.55
89	603681	永冠新材	21,650,869.09	2.55
90	601108	财通证券	21,543,493.60	2.53
91	600348	华阳股份	21,279,360.85	2.50
92	300012	华测检测	21,139,554.50	2.49
93	600998	九州通	21,022,053.22	2.47
94	300170	汉得信息	20,988,914.64	2.47



95	300639	凯普生物	20,634,047.69	2.43
96	601699	潞安环能	20,484,591.00	2.41
97	600438	通威股份	20,419,933.00	2.40
98	002439	启明星辰	20,142,117.00	2.37
99	600030	中信证券	20,087,648.15	2.36
100	300662	科锐国际	19,971,910.00	2.35
101	603026	胜华新材	19,887,239.00	2.34
102	600563	法拉电子	19,781,118.97	2.33
103	688289	圣湘生物	19,508,807.71	2.29
104	000933	神火股份	19,469,246.55	2.29
105	603345	安井食品	19,442,892.00	2.29
106	000960	锡业股份	19,431,864.83	2.28
107	603236	移远通信	19,336,243.57	2.27
108	603799	华友钴业	19,253,318.00	2.26
109	000983	山西焦煤	19,183,548.82	2.26
110	002738	中矿资源	19,050,338.00	2.24
111	000975	银泰黄金	19,049,779.35	2.24
112	000825	太钢不锈	18,949,948.89	2.23
113	600863	内蒙华电	18,933,496.52	2.23
114	600050	中国联通	18,741,797.20	2.20
115	300358	楚天科技	18,712,274.00	2.20
116	002594	比亚迪	18,610,258.16	2.19
117	000935	四川双马	18,514,794.99	2.18
118	601117	中国化学	18,253,687.00	2.15
119	000090	天健集团	18,206,407.00	2.14
120	000012	南玻 A	18,091,929.00	2.13
121	000039	中集集团	18,081,806.00	2.13
122	601899	紫金矿业	17,960,963.50	2.11
123	000959	首钢股份	17,950,563.00	2.11
124	600584	长电科技	17,908,778.70	2.11
125	600499	科达制造	17,731,964.51	2.08
126	002387	维信诺	17,516,598.00	2.06
127	601869	长飞光纤	17,368,521.70	2.04
128	603456	九洲药业	17,355,147.00	2.04
129	600155	华创阳安	17,305,944.00	2.03
130	600929	雪天盐业	17,274,386.86	2.03
131	000726	鲁泰 A	17,239,519.20	2.03
132	002042	华孚时尚	17,158,439.00	2.02
133	002709	天赐材料	17,078,514.84	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 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	600487	亨通光电	57,306,397.40	6.74
2	002396	星网锐捷	51,281,572.59	6.03
3	600256	广汇能源	51,063,070.74	6.00
4	600885	宏发股份	48,021,179.26	5.65
5	000728	国元证券	47,950,935.30	5.64
6	603613	国联股份	47,937,111.17	5.64
7	600157	永泰能源	46,226,855.00	5.43
8	600325	华发股份	43,613,619.38	5.13
9	600415	小商品城	39,775,017.45	4.68
10	600153	建发股份	39,240,706.92	4.61
11	300775	三角防务	38,979,688.00	4.58
12	000060	中金岭南	38,521,050.51	4.53
13	002460	赣锋锂业	38,515,491.00	4.53
14	600282	南钢股份	38,482,095.75	4.52
15	601128	常熟银行	37,184,489.33	4.37
16	601699	潞安环能	36,675,935.09	4.31
17	600141	兴发集团	36,419,963.18	4.28
18	300244	迪安诊断	36,120,722.66	4.25
19	002410	广联达	35,491,600.00	4.17
20	600718	东软集团	34,519,532.08	4.06
21	600808	马钢股份	33,985,250.60	4.00
22	002557	洽洽食品	33,563,711.74	3.95
23	002468	申通快递	32,971,295.03	3.88
24	600985	淮北矿业	32,780,882.20	3.85
25	300308	中际旭创	32,370,246.50	3.81
26	000598	兴蓉环境	32,224,702.00	3.79
27	600030	中信证券	31,969,152.77	3.76
28	600728	佳都科技	30,743,613.20	3.61
29	002966	苏州银行	30,310,807.20	3.56
30	300138	晨光生物	30,158,914.88	3.55
31	002807	江阴银行	30,053,945.00	3.53
32	000970	中科三环	29,995,940.16	3.53
33	002756	永兴材料	29,994,519.18	3.53
34	000039	中集集团	29,908,235.46	3.52
35	000686	东北证券	29,198,987.00	3.43
36	600089	特变电工	29,027,312.76	3.41
37	600546	山煤国际	28,606,295.00	3.36
38	000738	航发控制	28,547,943.00	3.36
39	688099	晶晨股份	28,040,132.61	3.30
40	000552	靖远煤电	27,869,336.65	3.28
41	600380	健康元	27,818,383.94	3.27
42	002637	赞宇科技	27,686,334.50	3.26
43	300181	佐力药业	27,565,317.88	3.24

44	600582	天地科技	27,545,395.16	3.24
45	600662	外服控股	27,486,243.78	3.23
46	601958	金钼股份	27,118,417.66	3.19
47	002517	恺英网络	27,009,424.00	3.18
48	000960	锡业股份	26,655,343.96	3.13
49	600064	南京高科	26,584,490.00	3.13
50	603599	广信股份	26,096,645.88	3.07
51	601615	明阳智能	25,869,565.93	3.04
52	300696	爱乐达	25,720,714.40	3.02
53	603668	天马科技	25,134,080.54	2.96
54	300390	天华超净	25,016,766.83	2.94
55	600598	北大荒	24,967,338.08	2.94
56	603712	七一二	24,225,565.54	2.85
57	002533	金杯电工	23,926,841.00	2.81
58	601098	中南传媒	23,903,667.40	2.81
59	600549	厦门钨业	23,888,432.00	2.81
60	603456	九洲药业	23,696,758.94	2.79
61	601881	中国银河	23,506,199.78	2.76
62	600566	济川药业	23,169,817.24	2.72
63	600373	中文传媒	23,168,116.51	2.72
64	603681	永冠新材	23,121,259.00	2.72
65	000878	云南铜业	23,065,171.10	2.71
66	002497	雅化集团	23,058,995.00	2.71
67	603883	老百姓	23,033,686.85	2.71
68	600438	通威股份	22,941,331.46	2.70
69	300037	新宙邦	22,796,054.46	2.68
70	601668	中国建筑	22,765,049.17	2.68
71	600057	厦门象屿	22,685,308.72	2.67
72	600901	江苏租赁	22,616,670.00	2.66
73	300170	汉得信息	22,544,160.83	2.65
74	600887	伊利股份	22,201,471.00	2.61
75	300457	赢合科技	22,142,316.95	2.60
76	600970	中材国际	21,941,949.74	2.58
77	300363	博腾股份	21,872,413.00	2.57
78	600529	山东药玻	21,686,582.44	2.55
79	600908	无锡银行	21,685,461.17	2.55
80	600909	华安证券	21,680,552.60	2.55
81	600572	康恩贝	21,679,433.00	2.55
82	600811	东方集团	21,640,180.15	2.54
83	002384	东山精密	21,634,479.00	2.54
84	600298	安琪酵母	21,417,458.60	2.52
85	000825	太钢不锈	21,401,894.70	2.52
86	002439	启明星辰	21,362,977.45	2.51

87	300115	长盈精密	21,305,041.00	2.50
88	600967	内蒙一机	21,274,441.55	2.50
89	000402	金融街	21,231,833.21	2.50
90	002085	万丰奥威	21,218,499.00	2.49
91	300073	当升科技	21,144,438.50	2.49
92	300012	华测检测	21,000,197.05	2.47
93	601231	环旭电子	20,943,029.00	2.46
94	600486	扬农化工	20,851,099.50	2.45
95	601555	东吴证券	20,849,616.29	2.45
96	600008	首创环保	20,719,264.65	2.44
97	000983	山西焦煤	20,686,084.00	2.43
98	000933	神火股份	20,481,151.20	2.41
99	000987	越秀资本	20,316,045.15	2.39
100	300395	菲利华	20,315,971.70	2.39
101	000959	首钢股份	20,285,074.00	2.38
102	600211	西藏药业	20,054,673.48	2.36
103	600271	航天信息	20,048,843.44	2.36
104	002649	博彦科技	19,887,248.83	2.34
105	000498	山东路桥	19,787,280.98	2.33
106	603236	移远通信	19,779,924.75	2.33
107	300639	凯普生物	19,687,350.17	2.31
108	603345	安井食品	19,559,084.84	2.30
109	300750	宁德时代	19,509,919.20	2.29
110	600050	中国联通	19,416,915.00	2.28
111	600348	华阳股份	19,071,025.00	2.24
112	600170	上海建工	18,994,614.92	2.23
113	000935	四川双马	18,961,067.00	2.23
114	601456	国联证券	18,684,695.50	2.20
115	601117	中国化学	18,619,908.00	2.19
116	002156	通富微电	18,522,231.51	2.18
117	603799	华友钴业	18,343,796.00	2.16
118	002709	天赐材料	18,342,643.40	2.16
119	000090	天健集团	18,211,557.20	2.14
120	600584	长电科技	18,206,992.00	2.14
121	600867	通化东宝	18,103,187.00	2.13
122	300662	科锐国际	18,086,862.08	2.13
123	600765	中航重机	17,931,601.14	2.11
124	300358	楚天科技	17,902,290.00	2.10
125	000726	鲁泰 A	17,879,541.40	2.10
126	600499	科达制造	17,744,577.24	2.09
127	601899	紫金矿业	17,701,280.77	2.08
128	002330	得利斯	17,412,132.00	2.05
129	600155	华创阳安	17,378,014.00	2.04

130	002387	维信诺	17,159,944.00	2.02
131	300772	运达股份	17,158,725.96	2.02
132	600929	雪天盐业	17,080,388.80	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	7,106,717,035.51
卖出股票收入（成交）总额	7,082,671,480.29

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率和交易成本。

#### 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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

## 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

江苏常熟农村商业银行股份有限公司（以下简称“常熟银行”）于 2022 年 12 月 28 日收到人民银行南京分行出具的行政处罚决定书（南银罚决字〔2022〕14 号），其因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送大额交易或者可疑交易报告等多项违法违规行为，被处罚款 6 万元。

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常熟银行进行了投资。

财通证券股份有限公司（以下简称“财通证券”，股票代码：601108）于 2022 年 11 月 30 日收到国家外汇管理局浙江省分局出具的行政处罚决定书，其因违反外汇账户管理规定，被罚款人民币 14 万元。

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财通证券进行了投资。

上海建工集团股份有限公司（以下简称“上海建工”，股票代码：600170）于 2022 年 4 月 15 日收到上海市生态环境局出具的行政处罚决定书，其因违反水污染防治管理制度，被罚款人民币 192,000.00 元。

上海建工于 2022 年 11 月 7 日收到南京市浦口区城乡建设局出具的行政处罚决定书，其因未按要求履行文明施工要求、造成现场扬尘污染，被罚款人民币 10,000.00 元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上海建工进行了投资。

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	220,398.55
2	应收清算款	325,434.60
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	333,312.48
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	879,145.63

#### 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 (%)
142,574	3,201.77	107,857,559.19	23.63	348,631,584.53	76.37

### 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	78,764.62	0.017254

### 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、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末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品情况

无。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年2月4日)基金份额总额	1,407,874,200.24
本报告期期初基金份额总额	433,972,422.96
本报告期基金总申购份额	178,571,168.75
减：本报告期基金总赎回份额	156,054,447.99

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	456,489,143.72

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

本基金聘请的安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 8 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 80,000.00 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	2,398,797,669.67	16.95	2,234,022.52	16.95	-
中信证券股份有限公司	4	1,769,998,689.17	12.50	1,648,414.77	12.50	-
光大证券股份有限公司	2	1,400,117,808.50	9.89	1,303,938.99	9.89	-
西部证券股份有限公司	2	1,001,007,218.84	7.07	932,239.65	7.07	-
国泰君安证券股份有限公司	1	944,834,711.77	6.67	879,932.16	6.67	-
中泰证券股份有限公司	2	896,463,536.09	6.33	834,879.75	6.33	-
华创证券有限责任公司	1	708,907,084.73	5.01	660,211.70	5.01	-
中信建投证券股份有限公司	2	640,527,626.09	4.52	596,528.45	4.52	-
天风证券股份有限公司	1	585,218,313.17	4.13	545,010.19	4.13	-
长城证券股份有限公司	2	549,993,527.89	3.89	512,208.84	3.89	-
渤海证券股份有限公司	1	503,317,934.26	3.56	468,744.41	3.56	-
东北证券股份有限公司	1	427,546,558.66	3.02	398,183.51	3.02	-
安信证券股份有限公司	1	374,053,734.09	2.64	348,356.01	2.64	-
国信证券股份有限公司	2	359,488,041.49	2.54	334,788.79	2.54	-
方正证券股份有限公司	1	320,427,599.63	2.26	298,417.51	2.26	-
东方财富证券股份有限公司	2	314,533,855.53	2.22	292,922.94	2.22	-
东方证券股份有限公司	1	298,811,415.64	2.11	278,284.25	2.11	-
中银国际证券股份有限公司	1	261,991,582.51	1.85	243,995.38	1.85	-
汇丰前海证券有限责任公司	1	161,998,033.40	1.14	150,871.05	1.14	-
华金证券股份有限公司	2	121,958,786.78	0.86	113,581.81	0.86	本期新增
长江证券股份有限公司	1	116,298,041.25	0.82	108,309.19	0.82	-
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：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	3,602,090.41	61.30	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	901,680.10	15.34	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	990,016.10	16.85	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	66,749.85	1.14	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	315,642.98	5.37	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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
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
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	景顺长城量化精选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景顺长城量化精选股票型证券投资基金在腾安基金销售（深圳）有限公司开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 2 月 9 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 18 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 2 月 25 日
15	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 3 月 4 日

	停机维护的公告	网站	
16	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
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	景顺长城量化精选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停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 16 日
23	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
24	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
25	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
26	景顺长城量化精选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
27	景顺长城基金管理有限公司关于终止上海朝阳永续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 27 日
28	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
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 5 月 6 日
30	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
31	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
32	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	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 5 月 26 日

	公告		
33	景顺长城量化精选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
34	景顺长城量化精选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
35	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
36	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
37	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
38	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
39	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
40	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
41	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
42	景顺长城量化精选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
43	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
44	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
45	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
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 8 月 6 日
47	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
48	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
49	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

50	景顺长城量化精选股票型证券投资基金 2022 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 8 月 31 日
51	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
52	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
53	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
54	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
55	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东兴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 10 月 10 日
56	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
57	景顺长城量化精选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
58	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
59	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
60	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
61	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
62	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
63	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 12 月 2 日
64	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员（财务负责人）变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 12 月 6 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 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

无。

### 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精选股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城量化精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城量化精选股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城量化精选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