

景顺长城量化先锋混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	55
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化先锋混合型证券投资基金	
基金简称	景顺长城量化先锋混合	
基金主代码	006201	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 9 月 12 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	40,371,763.36 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城量化先锋混合 A	景顺长城量化先锋混合 C
下属分级基金的交易代码	006201	018760
报告期末下属分级基金的份额总额	11,821,381.74 份	28,550,381.62 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要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</p> <p>本基金依据宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，重点关注包括 GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，形成资产配置方案。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金名称中的“量化先锋”主要指本基金采用的公司自建的量化模型，该量化模型主要采用超额收益模型、风险模型及交易成本模型三大类量化模型，并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，精选优质上市公司产出股票投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。本基金的量化投资主要依据基本面投资原则构建投资组合，控制对市场的冲击，而非单一趋势性交易或程序化交易。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况的研究，结合宏观经济模型（MEM），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，确定债券类的资产配置。通过预测收益率曲线变动的幅度和形状，对比不同信用等级、在不同市场交易债券的到期收益率，结合考虑流动性、票息、税收、可否回购等其他决定债券价值的因素，发行市场中个券相对失衡的状况。在债券构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、</p>

	利率预测、信用利差和时机策略等管理手段进行个券选择。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×85%+一年期人民币定期存款利率(税后)×15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳	许俊
	联系电话	0755-82370388	010-66596688
	电子邮箱	investor@igwfm.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008888606	95566
传真		0755-22381339	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		李进	葛海蛟

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	2023 年 6 月 29 日(C 类份额首个估值日)-2023 年 6 月 30 日
	景顺长城量化先锋混合 A	景顺长城量化先锋混合 C
本期已实现收益	-1,659,847.37	10,729.35
本期利润	-276,068.22	126,592.56
加权平均基金份额本期利润	-0.0086	4,062.6624
本期加权平均净值利润率	-0.60%	299,698.30%

本期基金份额净值增长率	-1.46%	0.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	4,254,840.49	10,276,252.94
期末可供分配基金份额利润	0.3599	0.3599
期末基金资产净值	16,076,222.23	38,826,634.56
期末基金份额净值	1.3599	1.3599
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	50.34%	0.88%

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。

5、本基金自 2023 年 6 月 28 日起增设 C 类基金份额，并于 2023 年 6 月 29 日开始对 C 类份额进行估值。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城量化先锋混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.64%	0.84%	0.57%	0.73%	1.07%	0.11%
过去三个月	-5.97%	0.76%	-4.37%	0.68%	-1.60%	0.08%
过去六个月	-1.46%	0.75%	0.18%	0.68%	-1.64%	0.07%
过去一年	-15.17%	0.93%	-10.48%	0.80%	-4.69%	0.13%
过去三年	9.63%	1.10%	-3.43%	0.98%	13.06%	0.12%
自基金合同生效起至今	50.34%	1.18%	20.39%	1.07%	29.95%	0.11%

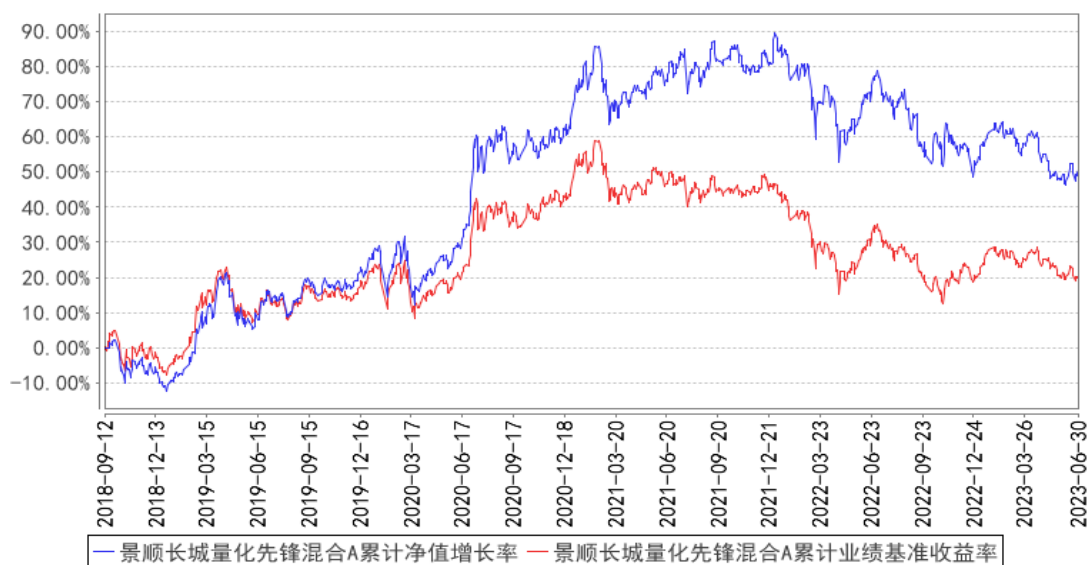
景顺长城量化先锋混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	0.88%	0.16%	0.24%	0.62%	0.64%	-0.46%

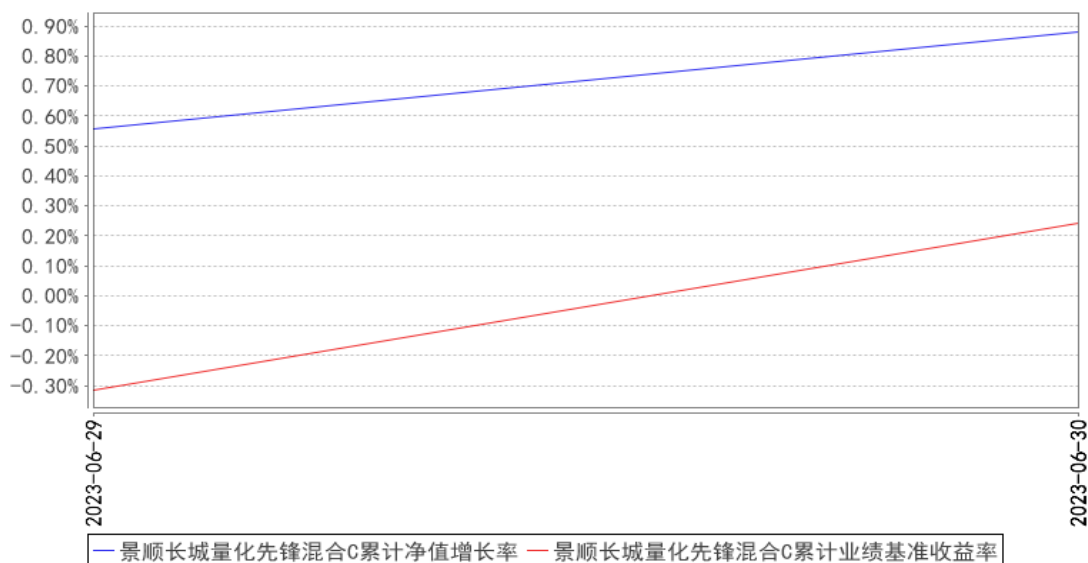
注：本基金自 2023 年 6 月 28 日起增设 C 类基金份额，并于 2023 年 6 月 29 日开始对 C 类份额进行估值。

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

景顺长城量化先锋混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城量化先锋混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 50%-95%；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，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。权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自 2018 年 9 月 12 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。本基金自 2023 年 6 月 28 日起增设 C 类基金份额。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76 号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2023 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 175 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		
徐喻军	本基金的基金经理	2019 年 7 月 16 日	-	13 年	理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员，自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 13 年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 17 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

2023 年上半年，国内经济整体呈现出弱复苏的态势，服务业的复苏较为明显，制造业和地产的复苏仍需观察，权益市场的表现也反映了较弱的经济和基本面预期。从国内来看，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 49.2、48.8、49.0，今年前 5 个月工业增加值累计同比增长 3.6%，其中 5 月份工业增加值当月同比增长 3.5%，经济复苏的节奏出现放缓的迹象。6 月 PPI 同比下降 5.4%，环比下降 0.8%；CPI 同比持平，环比下降 0.2%，通胀依旧温和。6 月 M2 同比增长 11.3%，M1 同比增速 3.1%，流动性充裕；6 月末外汇储备 3.19 万亿美元，汇率短期承压。整体而言，国内货币政策总体保持稳健，流动性充裕，宏观环境总体温和，经济依然是弱复苏的态势。上半年 A 股市场呈现

出先涨后跌的态势，风格上来看，价值风格优于成长风格。综合来看，上半年上证指数上涨 3.65%、沪深 300 指数下跌 0.75%，创业板指数下跌 5.61%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年上半年，景顺长城量化先锋混合 A 份额净值增长率为-1.46%，业绩比较基准收益率为 0.18%。

2023 年 6 月 29 日（C 类基金份额首个估值日）至本报告期末，景顺长城量化先锋混合 C 份额净值增长率为 0.88%，业绩比较基准收益率为 0.24%。

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 年下半年，海外方面，通胀大概率继续回落，美联储的货币政策依然是市场关注的热点，但其对国内资本市场的边际影响明显降低。国内方面，“稳增长”政策有望加快落地，或可对经济形成一定支撑，下半年货币政策预期维持宽松，预期流动性保持合理充裕。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。我们的投资组合仍然会维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生成长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生长期投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性、适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员

会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

从 2023 年 2 月 16 日至 2023 年 3 月 29 日，从 2023 年 5 月 8 日至 2023 年 6 月 29 日，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城量化先锋混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城量化先锋混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,412,101.54	3,605,924.29
结算备付金		510,955.00	696,110.95
存出保证金		311,915.53	641,052.15
交易性金融资产	6.4.7.2	14,463,756.00	41,066,842.18
其中：股票投资		12,955,861.48	41,042,803.56
基金投资		-	-
债券投资		1,507,894.52	24,038.62
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		693,084.08	-
应收股利		-	-
应收申购款		38,700,625.09	5,166,111.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		56,092,437.24	51,176,040.97
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		737,612.41	-
应付赎回款		2,252.19	-

应付管理人报酬		20,400.31	59,404.50
应付托管费		3,400.07	9,900.73
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		698.75	143.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	425,216.72	246,919.77
负债合计		1,189,580.45	316,368.53
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	40,371,763.36	36,852,827.82
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	14,531,093.43	14,006,844.62
净资产合计		54,902,856.79	50,859,672.44
负债和净资产总计		56,092,437.24	51,176,040.97

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，景顺长城量化先锋混合型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 1.3599 元，景顺长城量化先锋混合型证券投资基金 C 类基金份额净值人民币 1.3599 元，基金份额总额 40,371,763.36 份，其中景顺长城量化先锋混合型证券投资基金 A 类基金份额 11,821,381.74 份；景顺长城量化先锋混合型证券投资基金 C 类基金份额 28,550,381.62 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		323,370.31	343,090.17
1. 利息收入		20,295.79	7,253.44
其中：存款利息收入	6.4.7.13	20,295.79	7,253.44
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,695,602.39	-972,130.37
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,048,400.89	-1,205,767.01
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	10,720.81	6,536.28
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	112,645.57	-
股利收益	6.4.7.19	229,432.12	227,100.36
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,499,701.86	941,445.95
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	498,975.05	366,521.15
减：二、营业总支出		472,845.97	130,844.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	347,939.40	91,516.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	57,989.85	15,252.88
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		466.90	-
8. 其他费用	6.4.7.23	66,449.82	24,075.18
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-149,475.66	212,245.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-149,475.66	212,245.22
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-149,475.66	212,245.22

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产(基金净值)	36,852,827.82	-	14,006,844.62	50,859,672.44
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)	36,852,827.82	-	14,006,844.62	50,859,672.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,518,935.54	-	524,248.81	4,043,184.35
(一)、综合收益总额	-	-	-149,475.66	-149,475.66
(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)	3,518,935.54	-	673,724.47	4,192,660.01
其中：1. 基金申购款	82,434,405.08	-	33,194,908.67	115,629,313.75
2. 基金赎回款	-78,915,469.54	-	-32,521,184.20	-111,436,653.74
(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)	40,371,763.36	-	14,531,093.43	54,902,856.79
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	4,729,780.54	-	4,240,882.44	8,970,662.98
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)	4,729,780.54	-	4,240,882.44	8,970,662.98
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	53,940,791.10	-	41,071,787.27	95,012,578.37
(一)、综合收益总额	-	-	212,245.22	212,245.22
(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)	53,940,791.10	-	40,859,542.05	94,800,333.15
其中：1. 基金申购款	83,064,111.31	-	61,305,343.76	144,369,455.07
2. 基金赎回款	-29,123,320.21	-	-20,445,801.71	-49,569,121.92
(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)	58,670,571.64	-	45,312,669.71	103,983,241.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城量化先锋混合型证券投资基金（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[2018]1072 号文《关于准予景顺长城量化先锋混合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《景顺长城量化先锋混合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 2018 年 9 月 12 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 373,355,141.27 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 103,710.58 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 373,458,851.85 元，折合 373,458,851.85 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据法律法规的规定及《景顺长城量化先锋混合型证券投资基金基金合同》和《景顺长城量化先锋混合型证券投资基金招募说明书》的约定，经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2023 年 6 月 28 日起对景顺长城量化先锋混合型证券投资基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费；C 类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

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、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。

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 50%-95%；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，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。权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率 \times 85%+一年期人民币定期存款利率（税后） \times 15%。

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 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 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 3 号《半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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(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) 增值税及附加

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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）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。

(4) 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	1,412,101.54
等于：本金	1,411,962.39
加：应计利息	139.15
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	1,412,101.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	12,865,072.74	-	12,955,861.48	90,788.74	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,503,300.00	5,644.52	1,507,894.52	-1,050.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,503,300.00	5,644.52	1,507,894.52	-1,050.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	14,368,372.74	5,644.52	14,463,756.00	89,738.74	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	2,325,860.00	-	-	
其中：股指期货投资	2,325,860.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	2,325,860.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为初始合约价值。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2307	中证500股指期货2307	1.00	1,198,160.00	12,720.00
IF2307	沪深300股指期货2307	1.00	1,149,120.00	8,700.00
合计				21,420.00
减：可抵销期货暂收款				21,420.00
净额				-

注：(1) 衍生金融资产项下的股指期货投资净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已

包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

(2) 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末的买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8.06
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	361,345.54
其中：交易所市场	361,345.54
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	63,863.12
合计	425,216.72

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城量化先锋混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,852,827.82	36,852,827.82
本期申购	53,884,023.46	53,884,023.46
本期赎回（以“-”号填列）	-78,915,469.54	-78,915,469.54
本期末	11,821,381.74	11,821,381.74

景顺长城量化先锋混合 C

项目	本期 2023 年 6 月 29 日（C 类份额首个估值日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	28,550,381.62	28,550,381.62
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	28,550,381.62	28,550,381.62

注：（1）本基金于 2023 年 6 月 28 日增设 C 类基金份额，并于 2023 年 6 月 29 日开始对 C 类份额进行估值。

（2）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城量化先锋混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	22,661,618.15	-8,654,773.53	14,006,844.62
本期利润	-1,659,847.37	1,383,779.15	-276,068.22
本期基金份额交易产生的变动数	-14,613,278.42	5,137,342.51	-9,475,935.91
其中：基金申购款	33,999,586.99	-10,954,338.70	23,045,248.29
基金赎回款	-48,612,865.41	16,091,681.21	-32,521,184.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,388,492.36	-2,133,651.87	4,254,840.49

景顺长城量化先锋混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	10,729.35	115,863.21	126,592.56
本期基金份额交易产生的变动数	15,417,777.14	-5,268,116.76	10,149,660.38
其中：基金申购款	15,417,777.14	-5,268,116.76	10,149,660.38
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,428,506.49	-5,152,253.55	10,276,252.94

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	8,681.01
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	11,443.76
其他	171.02
合计	20,295.79

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,048,400.89
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	-2,048,400.89

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日

卖出股票成交总额	334,780,828.02
减：卖出股票成本总额	335,847,169.25
减：交易费用	982,059.66
买卖股票差价收入	-2,048,400.89

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	9.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	10,711.18
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	10,720.81

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	66,727.18
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	56,000.00
减：应计利息总额	13.26
减：交易费用	2.74
买卖债券差价收入	10,711.18

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	112,645.57

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	229,432.12
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	229,432.12

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	1,483,177.58
股票投资	1,483,262.58
债券投资	-85.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	17,020.00
权证投资	-
期货投资	17,020.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	495.72
合计	1,499,701.86

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	484,659.63
基金转换费收入	14,315.42
合计	498,975.05

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	48,986.73
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,586.70
合计	66,449.82

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
长城证券	29,971,795.00	4.68	2,392,438.00	2.35

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	27,912.73	4.68	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	2,228.27	2.35	2,228.27	2.71

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	347,939.40	91,516.89
其中：支付销售机构的客户维护费	43,435.45	27,296.98

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	57,989.85	15,252.88

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

6.4.10.2.3 销售服务费

1、基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

2、本基金于 2023 年 6 月 28 日起增加景顺长城量化先锋混合型证券投资基金的 C 类基金份额，原有基金份额全部自动划归为本基金 A 类基金份额。

3、本基金本报告期内无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	1,412,101.54	8,681.01	53,605,442.29	7,014.82

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，本基金未持有除国债、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%）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内,对基金组合资产中 7 个工作日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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,412,101.54	-	-	-	-	-	1,412,101.54
结算备付金	510,955.00	-	-	-	-	-	510,955.00
存出保证金	30,241.93	-	-	-	-	281,673.60	311,915.53
交易性金融资产	-	-	1,507,894.52	-	-	12,955,861.48	14,463,756.00
应收申购款	-	-	-	-	-	38,700,625.09	38,700,625.09
应收证券清算款	-	-	-	-	-	693,084.08	693,084.08
资产总计	1,953,298.47	-	1,507,894.52	-	-	52,631,244.25	56,092,437.24
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,252.19	2,252.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,400.31	20,400.31
应付托管费	-	-	-	-	-	3,400.07	3,400.07
应付证券清算款	-	-	-	-	-	737,612.41	737,612.41
应交税费	-	-	-	-	-	698.75	698.75
其他负债	-	-	-	-	-	425,216.72	425,216.72
负债总计	-	-	-	-	-	1,189,580.45	1,189,580.45
利率敏感度缺口	1,953,298.47	-	1,507,894.52	-	-	-	-
上年度末 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	3,605,924.29	-	-	-	-	-	3,605,924.29
结算备付金	696,110.95	-	-	-	-	-	696,110.95
存出保证金	32,293.75	-	-	-	-	608,758.40	641,052.15
交易性金融资	-	-	-	-	24,038.62	41,042,803.56	41,066,842.18

产							
应收申购款	-	-	-	-	-	5,166,111.40	5,166,111.40
资产总计	4,334,328.99	-	-	-	-24,038.62	46,817,673.36	51,176,040.97
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	59,404.50	59,404.50
应付托管费	-	-	-	-	-	9,900.73	9,900.73
应交税费	-	-	-	-	-	143.53	143.53
其他负债	-	-	-	-	-	246,919.77	246,919.77
负债总计	-	-	-	-	-	316,368.53	316,368.53
利率敏感度缺口	4,334,328.99	-	-	-	-24,038.62	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2023年6月30日）	上年度末 （2022年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-3,028.61	-
	市场利率下降 25 个基点	3,035.38	-

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	12,955,861.48	23.60	41,042,803.56	80.70

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	12,955,861.48	23.60	41,042,803.56	80.70

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注：6.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2023 年 6 月 30 日）	上年度末 （2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	2,071,811.00	1,622,546.83
	沪深 300 指数下降 5%	-2,071,811.00	-1,622,546.83

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	12,955,861.48	41,066,842.18
第二层次	1,507,894.52	-
第三层次	-	-

合计	14,463,756.00	41,066,842.18
----	---------------	---------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	12,955,861.48	23.10
	其中：股票	12,955,861.48	23.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,507,894.52	2.69
	其中：债券	1,507,894.52	2.69
	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	1,923,056.54	3.43
8	其他各项资产	39,705,624.70	70.79
9	合计	56,092,437.24	100.00

注：报告期末，本基金因客户申购出现投资比例被动超标，已在基金合同规定的期限内调整达标。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	71,360.00	0.13
B	采矿业	417,196.00	0.76
C	制造业	8,940,898.07	16.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	213,727.00	0.39
E	建筑业	254,778.00	0.46
F	批发和零售业	150,857.48	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	144,627.00	0.26
H	住宿和餐饮业	49,270.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,402,672.71	2.55
J	金融业	542,575.70	0.99
K	房地产业	126,737.00	0.23
L	租赁和商务服务业	199,086.00	0.36
M	科学研究和技术服务业	158,659.52	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	40,752.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	35,631.00	0.06
Q	卫生和社会工作	63,279.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	66,927.00	0.12
S	综合	76,828.00	0.14
	合计	12,955,861.48	23.60

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	100	169,100.00	0.31
2	000858	五粮液	700	114,499.00	0.21
3	000063	中兴通讯	2,200	100,188.00	0.18
4	002371	北方华创	300	95,295.00	0.17
5	688111	金山办公	200	94,444.00	0.17
6	688012	中微公司	600	93,870.00	0.17
7	300896	爱美客	200	88,990.00	0.16
8	600570	恒生电子	1,904	84,328.16	0.15
9	000568	泸州老窖	400	83,828.00	0.15

10	601318	中国平安	1,800	83,520.00	0.15
11	603688	石英股份	700	79,688.00	0.15
12	601888	中国中免	700	77,371.00	0.14
13	688120	华海清科	298	75,110.90	0.14
14	002475	立讯精密	2,200	71,390.00	0.13
15	600211	西藏药业	1,200	71,280.00	0.13
16	688556	高测股份	1,337	71,048.18	0.13
17	300856	科思股份	900	70,893.00	0.13
18	002273	水晶光电	5,800	69,252.00	0.13
19	301117	佳缘科技	1,000	64,620.00	0.12
20	688599	天合光能	1,501	63,957.61	0.12
21	603596	伯特利	800	63,408.00	0.12
22	002044	美年健康	8,900	63,279.00	0.12
23	002402	和而泰	3,700	62,826.00	0.11
24	300037	新宙邦	1,200	62,268.00	0.11
25	600919	江苏银行	8,400	61,740.00	0.11
26	002410	广联达	1,900	61,731.00	0.11
27	002182	云海金属	2,800	61,572.00	0.11
28	300855	图南股份	1,715	60,573.80	0.11
29	688305	科德数控	600	60,156.00	0.11
30	300760	迈瑞医疗	200	59,960.00	0.11
31	601882	海天精工	1,800	59,940.00	0.11
32	002384	东山精密	2,300	59,570.00	0.11
33	300750	宁德时代	260	59,485.40	0.11
34	002698	博实股份	3,400	59,466.00	0.11
35	600150	中国船舶	1,800	59,238.00	0.11
36	688981	中芯国际	1,169	59,057.88	0.11
37	688036	传音控股	400	58,800.00	0.11
38	600732	爱旭股份	1,900	58,425.00	0.11
39	300416	苏试试验	2,700	58,212.00	0.11
40	600566	济川药业	2,000	58,080.00	0.11
41	002049	紫光国微	600	55,950.00	0.10
42	600809	山西汾酒	300	55,521.00	0.10
43	601336	新华保险	1,500	55,155.00	0.10
44	688516	奥特维	291	54,824.40	0.10
45	002050	三花智控	1,800	54,468.00	0.10
46	600039	四川路桥	5,500	53,955.00	0.10
47	601688	华泰证券	3,900	53,703.00	0.10
48	600600	青岛啤酒	500	51,815.00	0.09
49	002594	比亚迪	200	51,654.00	0.09
50	002409	雅克科技	700	51,016.00	0.09
51	002179	中航光电	1,100	49,885.00	0.09
52	600183	生益科技	3,500	49,700.00	0.09

53	600258	首旅酒店	2,600	49,270.00	0.09
54	002737	葵花药业	2,000	48,680.00	0.09
55	002422	科伦药业	1,600	47,488.00	0.09
56	600212	绿能慧充	5,000	46,900.00	0.09
57	000048	京基智农	2,400	46,848.00	0.09
58	688390	固德威	280	46,720.80	0.09
59	601021	春秋航空	800	45,976.00	0.08
60	002429	兆驰股份	8,100	44,550.00	0.08
61	600750	江中药业	2,025	44,408.25	0.08
62	603345	安井食品	300	44,040.00	0.08
63	603290	斯达半导	200	43,040.00	0.08
64	688019	安集科技	260	42,855.80	0.08
65	688072	拓荆科技	100	42,597.00	0.08
66	002438	江苏神通	3,700	42,476.00	0.08
67	002129	TCL 中环	1,275	42,330.00	0.08
68	688630	芯碁微装	500	42,010.00	0.08
69	603156	养元饮品	1,700	41,990.00	0.08
70	001696	宗申动力	5,900	41,772.00	0.08
71	002027	分众传媒	6,100	41,541.00	0.08
72	603859	能科科技	800	40,904.00	0.07
73	600011	华能国际	4,400	40,744.00	0.07
74	601012	隆基绿能	1,400	40,138.00	0.07
75	603283	赛腾股份	900	40,050.00	0.07
76	600256	广汇能源	5,800	39,788.00	0.07
77	300122	智飞生物	900	39,780.00	0.07
78	688063	派能科技	200	39,650.00	0.07
79	600887	伊利股份	1,400	39,648.00	0.07
80	002912	中新赛克	900	39,609.00	0.07
81	003019	宸展光电	1,890	38,745.00	0.07
82	605009	豪悦护理	800	38,400.00	0.07
83	000733	振华科技	400	38,340.00	0.07
84	603456	九洲药业	1,400	38,332.00	0.07
85	600276	恒瑞医药	800	38,320.00	0.07
86	300633	开立医疗	700	38,150.00	0.07
87	688559	海目星	810	38,078.10	0.07
88	300036	超图软件	1,600	37,936.00	0.07
89	301268	铭利达	900	37,683.00	0.07
90	600060	海信视像	1,500	37,125.00	0.07
91	002459	晶澳科技	880	36,696.00	0.07
92	002139	拓邦股份	2,800	36,540.00	0.07
93	600642	申能股份	5,200	36,348.00	0.07
94	002518	科士达	900	36,009.00	0.07
95	600329	达仁堂	800	35,912.00	0.07

96	002917	金奥博	2,900	35,844.00	0.07
97	002017	东信和平	2,730	35,790.30	0.07
98	002439	启明星辰	1,200	35,712.00	0.07
99	600057	厦门象屿	4,100	35,670.00	0.06
100	605098	行动教育	900	35,631.00	0.06
101	002829	星网宇达	800	35,144.00	0.06
102	600050	中国联通	7,300	35,040.00	0.06
103	301004	嘉益股份	900	34,920.00	0.06
104	000338	潍柴动力	2,800	34,888.00	0.06
105	603628	清源股份	2,200	34,826.00	0.06
106	000913	钱江摩托	1,900	34,637.00	0.06
107	605499	东鹏饮料	200	34,580.00	0.06
108	000100	TCL 科技	8,770	34,553.80	0.06
109	601222	林洋能源	4,200	34,398.00	0.06
110	300634	彩讯股份	1,300	34,320.00	0.06
111	600438	通威股份	1,000	34,310.00	0.06
112	000301	东方盛虹	2,900	34,278.00	0.06
113	000997	新大陆	1,800	34,020.00	0.06
114	300130	新国都	1,200	33,996.00	0.06
115	002230	科大讯飞	500	33,980.00	0.06
116	002063	远光软件	3,900	33,852.00	0.06
117	603027	千禾味业	1,600	33,792.00	0.06
118	300775	三角防务	1,000	33,780.00	0.06
119	000739	普洛药业	1,900	33,706.00	0.06
120	600875	东方电气	1,800	33,570.00	0.06
121	002603	以岭药业	1,300	33,397.00	0.06
122	603383	顶点软件	600	33,252.00	0.06
123	000155	川能动力	2,300	33,120.00	0.06
123	002154	报喜鸟	6,000	33,120.00	0.06
124	300777	中简科技	700	33,082.00	0.06
125	605117	德业股份	220	32,901.00	0.06
126	601567	三星医疗	2,600	32,838.00	0.06
127	002056	横店东磁	1,800	32,778.00	0.06
128	002997	瑞鹄模具	1,100	32,703.00	0.06
129	600820	隧道股份	5,400	32,454.00	0.06
130	600096	云天化	1,900	32,433.00	0.06
131	002223	鱼跃医疗	900	32,391.00	0.06
132	601958	金钼股份	2,900	32,335.00	0.06
133	002885	京泉华	1,480	32,323.20	0.06
134	600985	淮北矿业	2,800	32,256.00	0.06
134	603639	海利尔	1,800	32,256.00	0.06
135	603878	武进不锈	3,800	32,110.00	0.06
136	600537	亿晶光电	4,200	32,088.00	0.06

137	601128	常熟银行	4,700	32,054.00	0.06
138	002025	航天电器	500	31,900.00	0.06
139	000425	徐工机械	4,700	31,819.00	0.06
140	300638	广和通	1,400	31,752.00	0.06
141	603369	今世缘	600	31,680.00	0.06
142	600583	海油工程	5,400	31,590.00	0.06
143	002033	丽江股份	2,900	31,552.00	0.06
144	002555	三七互娱	900	31,392.00	0.06
145	002373	千方科技	2,300	31,372.00	0.06
146	688126	沪硅产业	1,501	31,370.90	0.06
147	301029	怡合达	700	31,276.00	0.06
148	601377	兴业证券	5,100	31,212.00	0.06
149	600089	特变电工	1,400	31,206.00	0.06
150	002920	德赛西威	200	31,162.00	0.06
151	300511	雪榕生物	4,100	31,160.00	0.06
152	300537	广信材料	1,900	31,046.00	0.06
153	000625	长安汽车	2,400	31,032.00	0.06
153	002852	道道全	2,400	31,032.00	0.06
153	603551	奥普家居	2,400	31,032.00	0.06
154	601225	陕西煤业	1,700	30,923.00	0.06
155	300811	铂科新材	520	30,908.80	0.06
156	000928	中钢国际	3,200	30,880.00	0.06
157	300532	今天国际	1,500	30,840.00	0.06
158	002180	纳思达	900	30,825.00	0.06
159	300127	银河磁体	1,700	30,821.00	0.06
160	300327	中颖电子	1,100	30,756.00	0.06
160	600481	双良节能	2,200	30,756.00	0.06
161	603323	苏农银行	7,300	30,733.00	0.06
162	601618	中国中冶	7,700	30,569.00	0.06
163	603619	中曼石油	1,800	30,456.00	0.06
164	301039	中集车辆	2,300	30,429.00	0.06
165	300203	聚光科技	1,500	30,405.00	0.06
166	002065	东华软件	4,300	30,358.00	0.06
167	000906	浙商中拓	3,400	30,328.00	0.06
168	600582	天地科技	5,200	30,316.00	0.06
169	601163	三角轮胎	1,900	30,153.00	0.05
170	002739	万达电影	2,400	30,096.00	0.05
171	600901	江苏金租	7,280	30,066.40	0.05
172	300674	宇信科技	1,700	30,056.00	0.05
173	001979	招商蛇口	2,300	29,969.00	0.05
174	600603	广汇物流	4,300	29,928.00	0.05
175	300217	东方电热	5,100	29,886.00	0.05
176	601717	郑煤机	2,400	29,880.00	0.05

177	600161	天坛生物	1,100	29,865.00	0.05
178	600718	东软集团	2,800	29,848.00	0.05
179	603757	大元泵业	1,000	29,840.00	0.05
180	002600	领益智造	4,300	29,713.00	0.05
181	000589	贵州轮胎	5,300	29,680.00	0.05
182	301367	怡和嘉业	200	29,668.00	0.05
183	603368	柳药集团	1,200	29,652.00	0.05
184	000333	美的集团	500	29,460.00	0.05
185	002131	利欧股份	12,800	29,440.00	0.05
186	002533	金杯电工	3,600	29,376.00	0.05
187	002334	英威腾	2,300	29,302.00	0.05
188	601000	唐山港	8,300	29,299.00	0.05
189	600748	上实发展	7,400	29,230.00	0.05
190	003029	吉大正元	900	29,205.00	0.05
191	600728	佳都科技	4,200	29,106.00	0.05
192	601003	柳钢股份	7,200	29,088.00	0.05
193	002249	大洋电机	5,100	29,070.00	0.05
194	002727	一心堂	1,100	29,040.00	0.05
195	603505	金石资源	1,240	28,954.00	0.05
196	600285	羚锐制药	1,800	28,908.00	0.05
197	002008	大族激光	1,100	28,820.00	0.05
198	600085	同仁堂	500	28,780.00	0.05
199	600572	康恩贝	4,200	28,770.00	0.05
200	600301	华锡有色	1,600	28,720.00	0.05
201	002138	顺络电子	1,200	28,692.00	0.05
202	688030	山石网科	1,335	28,609.05	0.05
203	000591	太阳能	4,200	28,476.00	0.05
204	600064	南京高科	4,300	28,423.00	0.05
205	000157	中联重科	4,200	28,350.00	0.05
206	300224	正海磁材	2,200	28,292.00	0.05
207	600863	内蒙华电	6,800	28,220.00	0.05
208	603697	有友食品	3,060	28,060.20	0.05
209	688261	东微半导	200	27,974.00	0.05
210	600612	老凤祥	400	27,952.00	0.05
211	002424	贵州百灵	3,100	27,838.00	0.05
212	000629	钒钛股份	7,100	27,761.00	0.05
213	601877	正泰电器	1,000	27,650.00	0.05
214	002060	粤水电	4,200	27,636.00	0.05
215	000060	中金岭南	5,800	27,550.00	0.05
216	002625	光启技术	1,800	27,468.00	0.05
217	300232	洲明科技	3,000	27,420.00	0.05
218	688676	金盘科技	899	27,230.71	0.05
219	002003	伟星股份	2,900	27,144.00	0.05

220	300848	美瑞新材	1,300	26,975.00	0.05
221	002020	京新药业	2,100	26,922.00	0.05
222	002488	金固股份	3,900	26,910.00	0.05
223	300383	光环新网	2,500	26,875.00	0.05
224	000534	万泽股份	1,600	26,832.00	0.05
225	002372	伟星新材	1,300	26,702.00	0.05
226	688401	路维光电	699	26,240.46	0.05
227	300376	易事特	3,900	26,130.00	0.05
228	000877	天山股份	3,200	26,048.00	0.05
229	002458	益生股份	2,100	25,935.00	0.05
230	002541	鸿路钢构	900	25,929.00	0.05
231	603529	爱玛科技	800	25,776.00	0.05
232	000932	华菱钢铁	5,400	25,758.00	0.05
233	002478	常宝股份	3,400	25,330.00	0.05
234	605266	健之佳	300	25,149.00	0.05
235	000596	古井贡酒	100	24,738.00	0.05
236	688680	海优新材	200	24,364.00	0.04
237	600028	中国石化	3,800	24,168.00	0.04
238	688002	睿创微纳	537	24,057.60	0.04
239	600536	中国软件	500	23,440.00	0.04
240	601601	中国太保	900	23,382.00	0.04
241	603306	华懋科技	800	23,216.00	0.04
242	000603	盛达资源	1,900	22,971.00	0.04
243	688116	天奈科技	500	22,875.00	0.04
244	601898	中煤能源	2,700	22,788.00	0.04
245	601965	中国汽研	1,100	22,715.00	0.04
246	600502	安徽建工	4,300	22,704.00	0.04
247	300454	深信服	200	22,650.00	0.04
248	002916	深南电路	300	22,611.00	0.04
249	002815	崇达技术	1,800	22,410.00	0.04
250	603338	浙江鼎力	400	22,404.00	0.04
251	600559	老白干酒	900	22,059.00	0.04
252	600398	海澜之家	3,200	22,016.00	0.04
253	601019	山东出版	2,400	22,008.00	0.04
254	600487	亨通光电	1,500	21,990.00	0.04
255	688439	振华风光	200	21,964.00	0.04
256	601615	明阳智能	1,300	21,944.00	0.04
257	600970	中材国际	1,700	21,675.00	0.04
258	603595	东尼电子	500	21,410.00	0.04
259	300661	圣邦股份	260	21,353.80	0.04
260	002925	盈趣科技	1,100	21,340.00	0.04
261	002653	海思科	900	21,240.00	0.04
262	002128	电投能源	1,600	21,152.00	0.04

263	600547	山东黄金	900	21,132.00	0.04
264	603579	荣泰健康	1,000	20,920.00	0.04
265	000623	吉林敖东	1,300	20,852.00	0.04
266	300763	锦浪科技	200	20,820.00	0.04
267	688561	奇安信	400	20,724.00	0.04
268	600478	科力远	2,900	20,706.00	0.04
269	002544	普天科技	900	20,610.00	0.04
270	002283	天润工业	3,200	20,544.00	0.04
271	600498	烽火通信	1,000	20,370.00	0.04
272	002396	星网锐捷	900	20,331.00	0.04
273	601006	大秦铁路	2,700	20,061.00	0.04
274	002841	视源股份	300	20,052.00	0.04
275	000818	航锦科技	600	20,022.00	0.04
276	603609	禾丰股份	2,200	20,020.00	0.04
277	600025	华能水电	2,800	19,964.00	0.04
278	688700	东威科技	200	19,946.00	0.04
279	002583	海能达	3,400	19,754.00	0.04
280	603589	口子窖	400	19,740.00	0.04
281	002987	京北方	900	19,728.00	0.04
282	000688	国城矿业	1,300	19,721.00	0.04
283	000761	本钢板材	4,900	19,600.00	0.04
284	601211	国泰君安	1,400	19,586.00	0.04
285	600674	川投能源	1,300	19,565.00	0.04
286	002006	精工科技	900	19,413.00	0.04
287	300691	联合光电	1,100	19,382.00	0.04
288	600390	五矿资本	3,600	19,368.00	0.04
289	688349	三一重能	600	19,332.00	0.04
290	300782	卓胜微	200	19,326.00	0.04
291	002635	安洁科技	1,400	19,320.00	0.04
292	600845	宝信软件	380	19,307.80	0.04
293	300124	汇川技术	300	19,263.00	0.04
294	601069	西部黄金	1,500	19,260.00	0.04
295	601998	中信银行	3,200	19,136.00	0.03
296	002051	中工国际	1,600	19,088.00	0.03
297	688138	清溢光电	900	18,999.00	0.03
298	600446	金证股份	1,300	18,902.00	0.03
299	688425	铁建重工	3,908	18,797.48	0.03
300	002150	通润装备	1,100	18,689.00	0.03
301	002465	海格通信	1,800	18,612.00	0.03
302	601869	长飞光纤	500	18,505.00	0.03
303	300059	东方财富	1,300	18,460.00	0.03
304	300134	大富科技	1,800	18,450.00	0.03
304	600588	用友网络	900	18,450.00	0.03

305	000800	一汽解放	2,200	18,414.00	0.03
306	300770	新媒股份	400	18,344.00	0.03
307	688066	航天宏图	300	18,270.00	0.03
308	601369	陕鼓动力	2,000	18,220.00	0.03
309	600967	内蒙一机	1,800	18,180.00	0.03
310	300014	亿纬锂能	300	18,150.00	0.03
311	000567	海德股份	1,415	18,140.30	0.03
312	603713	密尔克卫	200	17,818.00	0.03
313	002236	大华股份	900	17,775.00	0.03
314	600779	水井坊	300	17,697.00	0.03
315	603556	海兴电力	700	17,668.00	0.03
316	300033	同花顺	100	17,528.00	0.03
317	002270	华明装备	1,600	17,520.00	0.03
318	603018	华设集团	2,000	17,500.00	0.03
319	600184	光电股份	1,300	17,069.00	0.03
320	002938	鹏鼎控股	700	17,003.00	0.03
321	300672	国科微	200	16,670.00	0.03
322	688369	致远互联	298	16,479.40	0.03
323	300379	东方通	800	16,456.00	0.03
324	002237	恒邦股份	1,500	16,335.00	0.03
325	300682	朗新科技	700	16,296.00	0.03
326	688186	广大特材	500	16,265.00	0.03
327	601168	西部矿业	1,500	15,765.00	0.03
328	002649	博彦科技	1,100	15,543.00	0.03
329	000058	深赛格	2,500	15,450.00	0.03
330	300349	金卡智能	1,100	15,268.00	0.03
331	601598	中国外运	3,200	14,912.00	0.03
332	300308	中际旭创	100	14,745.00	0.03
333	603392	万泰生物	220	14,689.40	0.03
334	002212	天融信	1,500	14,550.00	0.03
335	300802	矩子科技	600	14,442.00	0.03
336	300035	中科电气	1,200	14,424.00	0.03
337	688183	生益电子	1,169	14,144.90	0.03
338	600637	东方明珠	1,800	14,076.00	0.03
339	601028	玉龙股份	1,300	13,975.00	0.03
340	688560	明冠新材	500	13,895.00	0.03
341	300687	赛意信息	500	13,890.00	0.03
342	002314	南山控股	4,200	13,860.00	0.03
343	300206	理邦仪器	900	13,572.00	0.02
344	000951	中国重汽	800	13,480.00	0.02
345	003031	中瓷电子	100	13,312.00	0.02
346	600066	宇通客车	900	13,266.00	0.02
347	000028	国药一致	300	13,083.00	0.02

348	600535	天士力	900	13,059.00	0.02
349	600048	保利发展	1,000	13,030.00	0.02
350	688707	振华新材	422	12,993.38	0.02
351	603219	富佳股份	900	12,825.00	0.02
352	603993	洛阳钼业	2,400	12,792.00	0.02
353	603339	四方科技	800	12,728.00	0.02
354	002772	众兴菌业	1,100	12,430.00	0.02
355	002446	盛路通信	1,300	12,285.00	0.02
356	600399	抚顺特钢	1,200	12,240.00	0.02
357	002254	泰和新材	500	12,235.00	0.02
358	002489	浙江永强	3,000	12,150.00	0.02
359	601908	京运通	2,000	12,100.00	0.02
360	603171	税友股份	300	11,994.00	0.02
361	300525	博思软件	780	11,965.20	0.02
362	601939	建设银行	1,900	11,894.00	0.02
363	300565	科信技术	700	11,774.00	0.02
364	600195	中牧股份	1,000	11,680.00	0.02
365	300274	阳光电源	100	11,663.00	0.02
366	601117	中国化学	1,400	11,592.00	0.02
367	300183	东软载波	700	11,557.00	0.02
368	603236	移远通信	200	11,542.00	0.02
369	300613	富瀚微	200	11,348.00	0.02
370	300531	优博讯	800	11,312.00	0.02
371	600138	中青旅	900	11,259.00	0.02
372	600152	维科技术	1,200	11,136.00	0.02
373	688107	安路科技	200	11,078.00	0.02
374	002540	亚太科技	1,900	10,982.00	0.02
375	002651	利君股份	1,400	10,878.00	0.02
376	002335	科华数据	300	10,785.00	0.02
377	688578	艾力斯	400	10,780.00	0.02
378	688123	聚辰股份	200	10,744.00	0.02
379	000524	岭南控股	1,000	10,710.00	0.02
380	603212	赛伍技术	500	10,405.00	0.02
381	300413	芒果超媒	300	10,263.00	0.02
382	600233	圆通速递	700	10,192.00	0.02
383	300751	迈为股份	60	10,162.80	0.02
384	603515	欧普照明	500	10,150.00	0.02
385	002142	宁波银行	400	10,120.00	0.02
386	605339	南侨食品	500	9,955.00	0.02
387	002415	海康威视	300	9,933.00	0.02
388	600959	江苏有线	2,900	9,802.00	0.02
389	300181	佐力药业	800	9,768.00	0.02
390	002085	万丰奥威	1,400	9,702.00	0.02

391	002812	恩捷股份	100	9,635.00	0.02
391	300496	中科创达	100	9,635.00	0.02
392	603833	欧派家居	100	9,580.00	0.02
393	002860	星帅尔	700	9,436.00	0.02
394	300835	龙磁科技	300	9,414.00	0.02
395	002294	信立泰	300	9,357.00	0.02
396	600406	国电南瑞	400	9,240.00	0.02
397	603203	快克智能	300	9,234.00	0.02
398	600132	重庆啤酒	100	9,216.00	0.02
399	002549	凯美特气	800	9,200.00	0.02
400	688777	中控技术	145	9,103.10	0.02
401	300465	高伟达	900	8,937.00	0.02
402	688208	道通科技	292	8,850.52	0.02
403	600989	宝丰能源	700	8,827.00	0.02
404	603348	文灿股份	200	8,762.00	0.02
405	000555	神州信息	700	8,610.00	0.02
406	688221	前沿生物	800	8,528.00	0.02
407	688225	亚信安全	400	8,380.00	0.02
408	688007	光峰科技	400	8,340.00	0.02
409	603303	得邦照明	600	8,286.00	0.02
410	002152	广电运通	700	8,204.00	0.01
411	603811	诚意药业	660	8,203.80	0.01
412	688185	康希诺	100	8,150.00	0.01
413	600419	天润乳业	500	8,110.00	0.01
414	600038	中直股份	200	7,964.00	0.01
415	300101	振芯科技	400	7,756.00	0.01
416	688248	南网科技	200	7,678.00	0.01
417	600185	格力地产	1,100	7,546.00	0.01
418	603517	绝味食品	200	7,430.00	0.01
419	600363	联创光电	200	7,420.00	0.01
420	601139	深圳燃气	1,000	7,290.00	0.01
421	603893	瑞芯微	100	7,285.00	0.01
422	300316	晶盛机电	100	7,090.00	0.01
423	603300	华铁应急	1,300	7,085.00	0.01
424	600850	电科数字	300	7,077.00	0.01
425	603612	索通发展	400	6,932.00	0.01
426	002430	杭氧股份	200	6,872.00	0.01
427	300125	聆达股份	400	6,752.00	0.01
428	603806	福斯特	180	6,694.20	0.01
429	603516	淳中科技	300	6,615.00	0.01
430	300347	泰格医药	100	6,454.00	0.01
431	601872	招商轮船	1,100	6,369.00	0.01
432	000708	中信特钢	400	6,336.00	0.01

433	603868	飞科电器	100	6,309.00	0.01
434	300593	新雷能	270	6,185.70	0.01
435	300590	移为通信	500	6,110.00	0.01
436	603931	格林达	200	6,090.00	0.01
437	000999	华润三九	100	6,066.00	0.01
438	002895	川恒股份	300	5,910.00	0.01
439	002405	四维图新	500	5,790.00	0.01
440	002859	洁美科技	200	5,540.00	0.01
441	000528	柳工	700	5,530.00	0.01
442	300951	博硕科技	100	5,463.00	0.01
443	605377	华旺科技	300	5,415.00	0.01
444	688005	容百科技	100	5,402.00	0.01
445	300785	值得买	200	5,236.00	0.01
446	688046	药康生物	268	5,196.52	0.01
447	600998	九州通	496	5,148.48	0.01
448	688022	瀚川智能	140	5,058.20	0.01
449	002979	雷赛智能	200	4,752.00	0.01
450	603379	三美股份	200	4,702.00	0.01
451	002493	荣盛石化	400	4,656.00	0.01
452	688786	悦安新材	100	4,639.00	0.01
453	000050	深天马 A	500	4,590.00	0.01
454	601928	凤凰传媒	400	4,560.00	0.01
455	688298	东方生物	120	4,526.40	0.01
456	002648	卫星化学	300	4,488.00	0.01
457	601607	上海医药	200	4,482.00	0.01
458	688003	天准科技	100	4,463.00	0.01
459	002975	博杰股份	100	4,364.00	0.01
460	600968	海油发展	1,400	4,298.00	0.01
461	601611	中国核建	500	4,225.00	0.01
462	002947	恒铭达	200	4,168.00	0.01
463	600000	浦发银行	500	3,620.00	0.01
464	605020	永和股份	140	3,613.40	0.01
465	301026	浩通科技	100	3,572.00	0.01
466	600497	驰宏锌锗	700	3,514.00	0.01
467	001203	大中矿业	300	3,333.00	0.01
468	300735	光弘科技	300	3,210.00	0.01
469	605376	博迁新材	100	3,138.00	0.01
470	002933	新兴装备	100	2,937.00	0.01
471	601155	新城控股	200	2,882.00	0.01
472	600271	航天信息	200	2,738.00	0.00
473	002271	东方雨虹	100	2,726.00	0.00
474	688377	迪威尔	100	2,505.00	0.00
475	002955	鸿合科技	100	2,355.00	0.00

476	300869	康泰医学	100	2,296.00	0.00
477	600198	大唐电信	300	2,055.00	0.00
478	603033	三维股份	100	2,035.00	0.00
479	000166	申万宏源	400	1,848.00	0.00
480	300498	温氏股份	100	1,835.00	0.00
481	002915	中欣氟材	100	1,671.00	0.00
482	601137	博威合金	100	1,556.00	0.00
483	002011	盾安环境	100	1,383.00	0.00
484	300177	中海达	200	1,354.00	0.00
485	300382	斯莱克	100	1,319.00	0.00
486	002966	苏州银行	200	1,310.00	0.00
487	002453	华软科技	100	1,069.00	0.00
488	000517	荣安地产	300	915.00	0.00
489	002244	滨江集团	100	882.00	0.00
490	002443	金洲管道	100	666.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002049	紫光国微	2,812,793.00	5.53
2	002027	分众传媒	2,375,068.00	4.67
3	600985	淮北矿业	2,273,316.17	4.47
4	600702	舍得酒业	2,269,628.00	4.46
5	603290	斯达半导	2,228,103.00	4.38
6	002475	立讯精密	2,059,161.00	4.05
7	603688	石英股份	1,899,835.00	3.74
8	600256	广汇能源	1,892,462.00	3.72
9	002056	横店东磁	1,889,797.00	3.72
10	603605	珀莱雅	1,859,454.00	3.66
11	300861	美畅股份	1,845,732.66	3.63
12	603259	药明康德	1,814,018.00	3.57
13	601336	新华保险	1,770,973.00	3.48
14	600519	贵州茅台	1,754,608.00	3.45
15	600566	济川药业	1,712,648.00	3.37
16	600588	用友网络	1,668,760.00	3.28
17	300014	亿纬锂能	1,662,061.00	3.27
18	000425	徐工机械	1,615,200.00	3.18
19	600132	重庆啤酒	1,608,757.00	3.16
20	600795	国电电力	1,589,692.00	3.13
21	605499	东鹏饮料	1,574,152.00	3.10
22	600258	首旅酒店	1,570,975.00	3.09
23	601012	隆基绿能	1,548,083.92	3.04
24	603529	爱玛科技	1,544,138.00	3.04

25	603323	苏农银行	1,541,648.00	3.03
26	600570	恒生电子	1,511,502.04	2.97
27	002410	广联达	1,507,624.00	2.96
28	300009	安科生物	1,493,877.00	2.94
29	601916	浙商银行	1,485,455.00	2.92
30	601618	中国中冶	1,479,469.00	2.91
31	002179	中航光电	1,467,465.00	2.89
32	002807	江阴银行	1,455,309.00	2.86
33	300910	瑞丰新材	1,448,648.00	2.85
34	002050	三花智控	1,404,249.00	2.76
35	600732	爱旭股份	1,387,900.00	2.73
36	000915	华特达因	1,386,262.00	2.73
37	688261	东微半导	1,364,964.24	2.68
38	600039	四川路桥	1,350,801.00	2.66
39	600809	山西汾酒	1,348,689.00	2.65
40	688012	中微公司	1,347,386.43	2.65
41	002025	航天电器	1,343,241.00	2.64
42	300896	爱美客	1,331,458.00	2.62
43	600808	马钢股份	1,308,499.00	2.57
44	600845	宝信软件	1,298,313.00	2.55
45	300661	圣邦股份	1,288,886.00	2.53
46	000729	燕京啤酒	1,281,245.00	2.52
47	002594	比亚迪	1,274,227.39	2.51
48	002843	泰嘉股份	1,266,069.00	2.49
49	600699	均胜电子	1,261,963.00	2.48
50	000423	东阿阿胶	1,258,753.00	2.47
51	300511	雪榕生物	1,255,062.00	2.47
52	600089	特变电工	1,252,840.00	2.46
53	600150	中国船舶	1,239,776.00	2.44
54	000725	京东方 A	1,239,218.00	2.44
55	300207	欣旺达	1,231,636.00	2.42
56	300450	先导智能	1,227,093.00	2.41
57	002429	兆驰股份	1,226,397.00	2.41
58	688111	金山办公	1,225,316.52	2.41
59	000100	TCL 科技	1,217,392.00	2.39
60	000513	丽珠集团	1,204,790.00	2.37
61	600535	天士力	1,202,856.00	2.37
62	600266	城建发展	1,202,195.00	2.36
63	000999	华润三九	1,187,234.00	2.33
64	000776	广发证券	1,174,750.00	2.31
65	605117	德业股份	1,172,167.00	2.30
66	002384	东山精密	1,147,853.00	2.26
67	002304	洋河股份	1,140,837.00	2.24

68	002937	兴瑞科技	1,136,318.00	2.23
69	603665	康隆达	1,135,144.00	2.23
70	600901	江苏金租	1,122,861.00	2.21
71	002517	恺英网络	1,115,040.00	2.19
72	600741	华域汽车	1,095,221.00	2.15
73	000596	古井贡酒	1,095,174.00	2.15
74	002436	兴森科技	1,074,691.00	2.11
75	603026	胜华新材	1,066,892.00	2.10
76	600600	青岛啤酒	1,030,880.00	2.03
77	002044	美年健康	1,026,121.00	2.02
78	603027	千禾味业	1,020,413.00	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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603259	药明康德	2,854,017.00	5.61
2	002475	立讯精密	2,805,104.00	5.52
3	002049	紫光国微	2,713,076.00	5.33
4	002594	比亚迪	2,471,434.00	4.86
5	600570	恒生电子	2,435,171.96	4.79
6	002027	分众传媒	2,287,300.00	4.50
7	600702	舍得酒业	2,246,236.00	4.42
8	002410	广联达	2,227,239.00	4.38
9	600985	淮北矿业	2,220,708.83	4.37
10	603290	斯达半导	2,109,712.00	4.15
11	300014	亿纬锂能	2,067,622.00	4.07
12	600809	山西汾酒	2,056,890.00	4.04
13	300861	美畅股份	1,980,549.00	3.89
14	600089	特变电工	1,939,962.00	3.81
15	601336	新华保险	1,937,574.00	3.81
16	605117	德业股份	1,922,566.00	3.78
17	002807	江阴银行	1,917,995.00	3.77
18	300910	瑞丰新材	1,914,118.00	3.76
19	603688	石英股份	1,908,283.00	3.75
20	002179	中航光电	1,883,288.60	3.70
21	603605	珀莱雅	1,853,151.22	3.64
22	002304	洋河股份	1,851,701.00	3.64
23	002056	横店东磁	1,797,309.00	3.53
24	600732	爱旭股份	1,797,216.00	3.53
25	600566	济川药业	1,770,012.00	3.48
26	601601	中国太保	1,761,479.00	3.46
27	600256	广汇能源	1,733,746.00	3.41
28	300450	先导智能	1,701,242.00	3.34

29	002517	恺英网络	1,693,461.84	3.33
30	300101	振芯科技	1,691,494.00	3.33
31	600588	用友网络	1,678,725.00	3.30
32	300896	爱美客	1,673,409.53	3.29
33	603529	爱玛科技	1,651,435.00	3.25
34	300207	欣旺达	1,635,719.00	3.22
35	600132	重庆啤酒	1,611,213.00	3.17
36	600795	国电电力	1,610,071.00	3.17
37	601012	隆基绿能	1,585,410.57	3.12
38	600519	贵州茅台	1,552,839.00	3.05
39	000915	华特达因	1,511,402.00	2.97
40	603323	苏农银行	1,508,614.00	2.97
41	601618	中国中冶	1,508,560.00	2.97
42	000425	徐工机械	1,500,675.00	2.95
43	600741	华域汽车	1,490,779.00	2.93
44	300009	安科生物	1,470,464.00	2.89
45	601916	浙商银行	1,460,805.00	2.87
46	605499	东鹏饮料	1,455,884.00	2.86
47	600258	首旅酒店	1,406,714.00	2.77
48	601869	长飞光纤	1,404,405.00	2.76
49	002025	航天电器	1,370,519.00	2.69
50	002050	三花智控	1,363,134.00	2.68
51	688012	中微公司	1,355,108.46	2.66
52	600039	四川路桥	1,354,074.00	2.66
53	688261	东微半导	1,349,998.06	2.65
54	600150	中国船舶	1,346,255.00	2.65
55	600383	金地集团	1,343,948.00	2.64
56	600546	山煤国际	1,331,214.00	2.62
57	600808	马钢股份	1,308,310.00	2.57
58	000729	燕京啤酒	1,304,019.00	2.56
59	300511	雪榕生物	1,290,720.00	2.54
60	600845	宝信软件	1,290,322.00	2.54
61	000423	东阿阿胶	1,287,423.00	2.53
62	688111	金山办公	1,286,494.27	2.53
63	000999	华润三九	1,280,119.00	2.52
64	300661	圣邦股份	1,276,107.00	2.51
65	600153	建发股份	1,259,751.00	2.48
66	000513	丽珠集团	1,258,944.96	2.48
67	600535	天士力	1,253,419.00	2.46
68	600699	均胜电子	1,250,374.00	2.46
69	600266	城建发展	1,250,119.00	2.46
70	002843	泰嘉股份	1,248,760.00	2.46
71	002821	凯莱英	1,240,940.00	2.44

72	000725	京东方 A	1,207,503.00	2.37
73	000776	广发证券	1,196,156.00	2.35
74	002429	兆驰股份	1,187,595.00	2.34
75	300316	晶盛机电	1,165,147.00	2.29
76	603665	康隆达	1,163,408.00	2.29
77	000100	TCL 科技	1,152,146.00	2.27
78	000012	南玻 A	1,143,840.00	2.25
79	603369	今世缘	1,137,094.00	2.24
80	002324	普利特	1,128,285.00	2.22
81	600901	江苏金租	1,100,783.00	2.16
82	002436	兴森科技	1,094,088.00	2.15
83	002384	东山精密	1,090,159.00	2.14
84	000596	古井贡酒	1,082,254.00	2.13
85	002937	兴瑞科技	1,073,574.00	2.11
86	002938	鹏鼎控股	1,054,345.00	2.07
87	000876	新希望	1,025,622.00	2.02
88	600211	西藏药业	1,023,341.00	2.01
89	603027	千禾味业	1,021,693.32	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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	306,276,964.59
卖出股票收入（成交）总额	334,780,828.02

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,507,894.52	2.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,507,894.52	2.75

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	102238	国债 2310	15,000	1,507,894.52	2.75

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

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

中国平安保险（集团）股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

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

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

日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	311,915.53
2	应收清算款	693,084.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	38,700,625.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,705,624.70

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
景顺长城量化先锋混合 A	715	16,533.40	4,958,588.84	41.95	6,862,792.90	58.05
景顺长城量化先锋混合 C	35	815,725.19	7,377,351.53	25.84	21,173,030.09	74.16
合计	750	53,829.02	12,335,940.37	30.56	28,035,822.99	69.44

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采

用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	景顺长城量化先锋混合 A	568,595.24	4.809888
	景顺长城量化先锋混合 C	31.16	0.000109
	合计	568,626.40	1.408476

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	景顺长城量化先锋混合 A	10~50
	景顺长城量化先锋混合 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城量化先锋混合 A	10~50
	景顺长城量化先锋混合 C	-
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城量化先锋混合 A	景顺长城量化先锋混合 C
基金合同生效日(2018年9月12日)基金份额总额	373,458,851.85	-
本报告期期初基金份额总额	36,852,827.82	-
本报告期基金总申购份额	53,884,023.46	28,550,381.62
减：本报告期基金总赎回份额	78,915,469.54	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	11,821,381.74	28,550,381.62

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国盛证券有限责任公司	1	117,924,223.72	18.40	109,825.16	18.40	-
中泰证券股份有限公司	1	90,957,122.91	14.19	84,708.62	14.19	-
华泰证券股份有限公司	1	82,428,219.06	12.86	76,767.06	12.86	-
东方证券股份有限公司	2	78,274,498.81	12.21	72,898.36	12.21	-
德邦证券股份有限公司	1	53,333,522.51	8.32	49,669.93	8.32	本期报告新增1个
广发证券股份有限公司	2	43,028,131.02	6.71	40,072.55	6.71	-

海通证券股份有限公司	2	37,290,058.47	5.82	34,728.69	5.82	-
浙商证券股份有限公司	1	37,185,982.25	5.80	34,631.62	5.80	-
华西证券股份有限公司	1	34,814,807.98	5.43	32,423.44	5.43	-
长城证券股份有限公司	3	29,971,795.00	4.68	27,912.73	4.68	-
信达证券股份有限公司	1	16,176,290.60	2.52	15,065.04	2.52	-
华宝证券股份有限公司	2	10,365,076.02	1.62	9,653.06	1.62	本期报告新增2个
中信建投证券股份有限公司	2	8,241,919.60	1.29	7,675.78	1.29	-
招商证券股份有限公司	2	859,191.37	0.13	800.16	0.13	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1,503,300.00	95.75	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	58,196.31	3.71	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	8,530.87	0.54	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股	-	-	-	-	-	-

份有限公司						
平安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
2	景顺长城量化先锋混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
3	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	2023 年 2 月 10 日
4	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	2023 年 2 月 24 日
5	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	2023 年 3 月 25 日
6	景顺长城量化先锋混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
8	关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司银银平台“机构投资交易平台”为销售平台并开通基金转换业务及参加申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
9	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	2023 年 4 月 8 日
10	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	2023 年 4 月 18 日
11	景顺长城量化先锋混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 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	2023 年 4 月 22 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	2023 年 5 月 6 日

15	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	2023 年 5 月 13 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 27 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 10 日
18	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	2023 年 6 月 17 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 22 日
20	景顺长城量化先锋混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 28 日
21	景顺长城量化先锋混合型证券投资基金基金合同更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 28 日
22	景顺长城量化先锋混合型证券投资基金托管协议更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 28 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城量化先锋混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同、托管协议部分条款的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 28 日
24	景顺长城量化先锋混合型证券投资基金关于开放 C 类份额日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 28 日
25	景顺长城量化先锋混合型证券投资基金 2023 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 28 日
26	关于景顺长城量化先锋混合型证券投资基金新增江海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	2023 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20230407-20230507	0.00	13,990,206.37	13,990,206.37	0.00	0.00
	2	20230322-20230329; 20230508-20230605	5,829,429.41	0.00	5,829,429.41	0.00	0.00
	3	20230606-20230629	0.00	2,446,451.37	0.00	2,446,451.37	6.06
	4	20230101-20230321	11,293,765.53	0.00	11,293,765.53	0.00	0.00

	5	20230101-20230329; 20230407-20230528	11,293,765.43	0.00	11,293,765.43	0.00	0.00
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>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。</p> <p>2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：</p> <p>（1）基金在短时间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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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。</p> <p>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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足不同类型的投资者的投资需求，根据《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》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》等法律法规的规定和《景顺长城量化先锋混合型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2023 年 6 月 28 日起对景顺长城量化先锋混合型证券投资基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额，同时对《基金合同》和《托管协议》进行了相应的修改。详情请参阅本基金管理人于 2023 年 6 月 28 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城量化先锋混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同、托管协议部分条款的公告》。

为了更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与本基金的基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2023 年 8 月 22 日起，调低本基金的管理费率和托管费率并对基金合同有关条款进行修订。详情请参阅本基金管理人于 2023 年 8 月 18 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基

金合同的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城量化先锋混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城量化先锋混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城量化先锋混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城量化先锋混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日