

# 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

<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 主要财务指标和基金净值表现</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
<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 .....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
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 .....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	11
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 .....	11
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 .....	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表 .....	11
6.2 利润表 .....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	14
6.4 报表附注 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	58

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 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
7.12 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
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 .....	61
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>61</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
10.4 基金投资策略的改变 .....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
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 .....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
10.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</b>
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 .....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>68</b>
12.1 备查文件目录 .....	68
12.2 存放地点 .....	68
12.3 查阅方式 .....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城量化小盘股票
场内简称	无
基金主代码	005457
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 2 月 6 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,117,700,273.04 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型精选股票，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略： 本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略： 本基金主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。</p> <p>3、债券投资策略： 出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金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)
本期已实现收益	10,608,061.30
本期利润	36,647,867.75
加权平均基金份额本期利润	0.0609
本期加权平均净值利润率	3.77%
本期基金份额净值增长率	5.97%
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	406,129,804.41
期末可供分配基金份额利润	0.3634
期末基金资产净值	1,523,830,077.45
期末基金份额净值	1.3633
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	60.52%

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

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

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

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

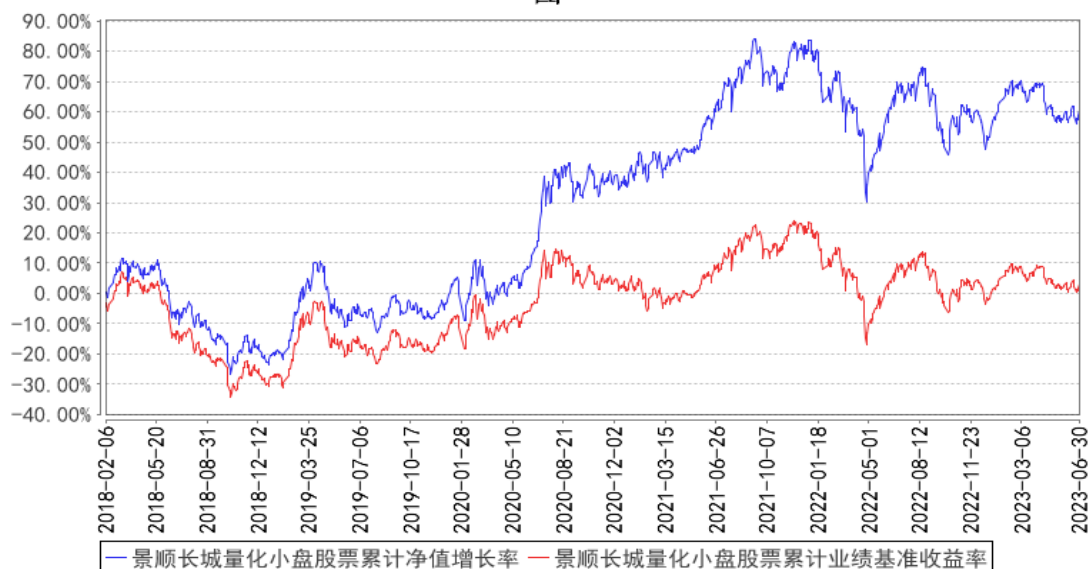
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.39%	0.94%	0.59%	0.99%	0.80%	-0.05%
过去三个月	-4.52%	0.85%	-3.77%	0.87%	-0.75%	-0.02%
过去六个月	5.97%	0.83%	4.87%	0.84%	1.10%	-0.01%
过去一年	-4.42%	1.04%	-5.27%	1.05%	0.85%	-0.01%
过去三年	36.83%	1.27%	4.64%	1.30%	32.19%	-0.03%
自基金合同生效起至今	60.52%	1.41%	2.89%	1.43%	57.63%	-0.02%

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

景顺长城量化小盘股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

### 3.3 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		
黎海威	本基金的基金经理	2018年2月6日	-	20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20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、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，本基金份额净值增长率为 5.97%，业绩比较基准收益率为 4.87%。

#### 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及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部

负责对外进行信息披露。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施了一次利润分配。截至 2023 年 6 月 21 日，本基金可供分配利润为 648,751,607.99 元。本基金的基金管理人已于 2023 年 6 月 28 日完成权益登记，本基金每 10 份基金份额派发红利 2.38 元，详细信息请查阅相关分红公告。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

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	99,033,917.71	29,280,457.86
结算备付金		39,364,360.44	2,485,449.52
存出保证金		5,286,539.38	316,290.19
交易性金融资产	6.4.7.2	1,395,218,987.25	479,660,016.70
其中：股票投资		1,393,494,843.66	479,660,016.70
基金投资		-	-
债券投资		1,724,143.59	-
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		-	3,765,276.40
应收股利		-	-
应收申购款		417,233.37	166,612.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,539,321,038.15	515,674,103.60
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,092,998.43	2,989,206.15
应付赎回款		443,214.04	1,106,948.22
应付管理人报酬		2,153,431.08	702,986.93
应付托管费		358,905.21	117,164.47
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4.68	3.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	5,442,407.26	2,406,853.52
负债合计		15,490,960.70	7,323,162.34
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.10	1,117,700,273.04	335,576,804.15
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	406,129,804.41	172,774,137.11
净资产合计		1,523,830,077.45	508,350,941.26
负债和净资产总计		1,539,321,038.15	515,674,103.60

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3633 元，基金份额总额 1,117,700,273.04 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：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
<b>一、营业总收入</b>		45,116,810.83	-105,836,674.17
1. 利息收入		271,593.89	154,049.86
其中：存款利息收入	6.4.7.13	271,593.89	154,049.86
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）		18,449,980.33	-143,635,069.69
其中：股票投资收益	6.4.7.14	8,428,242.45	-151,140,161.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	762,762.21	455,436.27
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-2,719,014.86	-
股利收益	6.4.7.19	11,977,990.53	7,049,655.52
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	26,039,806.45	36,361,136.21
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	355, 430. 16	1, 283, 209. 45
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>8, 468, 943. 08</b>	<b>7, 413, 888. 05</b>
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	7, 179, 804. 77	6, 276, 343. 33
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	1, 196, 634. 11	1, 046, 057. 25
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		98. 09	1. 55
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	92, 406. 11	91, 485. 92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>36, 647, 867. 75</b>	<b>-113, 250, 562. 22</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>36, 647, 867. 75</b>	<b>-113, 250, 562. 22</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>36, 647, 867. 75</b>	<b>-113, 250, 562. 22</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：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）	335, 576, 804. 15	-	172, 774, 137. 11	508, 350, 941. 26
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）	335, 576, 804. 15	-	172, 774, 137. 11	508, 350, 941. 26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	782, 123, 468. 89	-	233, 355, 667. 30	1, 015, 479, 136. 19
（一）、综合收益	-	-	36, 647, 867. 75	36, 647, 867. 75

总额				
(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)	782,123,468.89	-	457,918,629.91	1,240,042,098.80
其中:1.基金申购款	880,328,147.02	-	519,938,922.81	1,400,267,069.83
2.基金赎回款	-98,204,678.13	-	-62,020,292.90	-160,224,971.03
(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)	-	-	-261,210,830.36	-261,210,830.36
(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)	1,117,700,273.04	-	406,129,804.41	1,523,830,077.45
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)	381,481,082.93	-	319,030,729.85	700,511,812.78
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)	381,481,082.93	-	319,030,729.85	700,511,812.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	109,959,220.53	-	14,943,952.16	124,903,172.69
(一)、综合收益总额	-	-	-113,250,562.22	-113,250,562.22
(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)	109,959,220.53	-	128,194,514.38	238,153,734.91

其中：1. 基金申购款	403,073,012.82	-	284,320,068.39	687,393,081.21
2. 基金赎回款	-293,113,792.29	-	-156,125,554.01	-449,239,346.30
(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)	491,440,303.46	-	333,974,682.01	825,414,985.47

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股



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

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2023 年 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前(如适用)运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起(如适用)产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前

取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请, 由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利, 由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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	99,033,917.71
等于: 本金	99,020,873.56
加: 应计利息	13,044.15
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	99,033,917.71

##### 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	1,397,483,288.21	-	1,393,494,843.66	-3,988,444.55

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,724,000.00	143.59	1,724,143.59	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,724,000.00	143.59	1,724,143.59	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,399,207,288.21	143.59	1,395,218,987.25	-3,988,444.55

#### 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	40,197,665.45	-	-	-
其中：股指期货投资	40,197,665.45	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	40,197,665.45	-	-	-

##### 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
IM2307	中证1000股指期货2307合约	15.00	19,724,400.00	209,254.55
IM2308	中证1000股指期货2308合约	16.00	20,988,800.00	306,280.00
合计				515,534.55
减：可抵销期货 暂收款				515,534.55
净额				-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，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。

##### 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	713.27
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,352,433.84

其中：交易所市场	5,352,433.84
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	5,442,407.26

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	335,576,804.15	335,576,804.15
本期申购	880,328,147.02	880,328,147.02
本期赎回（以“-”号填列）	-98,204,678.13	-98,204,678.13
本期末	1,117,700,273.04	1,117,700,273.04

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	213,142,312.84	-40,368,175.73	172,774,137.11
本期利润	10,608,061.30	26,039,806.45	36,647,867.75
本期基金份额交易产生的变动数	497,970,287.92	-40,051,658.01	457,918,629.91
其中：基金申购款	564,303,983.22	-44,365,060.41	519,938,922.81
基金赎回款	-66,333,695.30	4,313,402.40	-62,020,292.90
本期已分配利润	-261,210,830.36	-	-261,210,830.36
本期末	460,509,831.70	-54,380,027.29	406,129,804.41

#### 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	138,418.09
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	130,698.51	
其他	2,477.29	
合计	271,593.89	

## 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	8,428,242.45
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	8,428,242.45

## 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	3,872,561,783.75
减：卖出股票成本总额	3,851,571,152.38
减：交易费用	12,562,388.92
买卖股票差价收入	8,428,242.45

## 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	712.01
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	762,050.20
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	762,762.21

## 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	3,885,795.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,123,000.00
减：应计利息总额	589.69
减：交易费用	155.68

买卖债券差价收入	762,050.20
----------	------------

#### 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	-2,719,014.86

#### 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	11,977,990.53
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	11,977,990.53

#### 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	25,524,271.90
股票投资	25,524,271.90
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-



贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	515,534.55
权证投资	-
期货投资	515,534.55
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	26,039,806.45

#### 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	345,198.67
基金转换费收入	10,231.49
合计	355,430.16

#### 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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,785.96
其他	360.00
合计	92,406.11

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

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		上年度可比期间 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	25,576,562.31	0.30	-	-

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 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	23,819.84	0.30	23,819.84	0.45
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	-	-	-	-

注：1. 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。

2. 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	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管理费	7,179,804.77	6,276,343.33
其中：支付销售机构的客户维护费	1,251,922.93	1,603,008.61

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

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

#### 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	1,196,634.11	1,046,057.25

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

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 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 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	
	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	99,033,917.71	138,418.09	52,652,146.36	105,286.80

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配合 计	备注
1	2023 年 6 月 28 日	2023 年 6 月 28 日	2.3800	234,809,936.18	26,400,894.18	261,210,830.36	-
合计	-	-	2.3800	234,809,936.18	26,400,894.18	261,210,830.36	-

#### 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流 通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流 通受限	11.88	21.02	1,154	13,709.52	24,257.08	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流 通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流 通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流 通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流 通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流 通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-

301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月以上	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股流通受限	131.11	53.24	256	33,564.16	13,629.44	-
301322	绿通科技	2023年5月25日	1-6个月(含)	新股流通受限	-	53.24	128	-	6,814.72	转增股
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-

301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	661	15,711.97	28,350.29	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	2,547	16,759.26	19,306.26	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月	6 个月	新股流	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-

		月 10 日		通受限						
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	760	27,474.00	28,978.80	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	5,578	110,779.08	100,738.68	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	5.69	5.41	10,447	59,443.43	56,518.27	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	3,624	40,226.40	61,752.96	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688502	茂莱光学	2023 年 2 月 28 日	6 个月	新股流通受限	69.72	178.59	1,509	105,207.48	269,492.31	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	152.38	135.97	283	43,123.54	38,479.51	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-

688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	二元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127086	恒邦转债	2023 年 6 月 12 日	1 个月内 (含)	新债未上市	100.00	100.01	17,240	1,724,000.00	1,724,143.59	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

截止本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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



理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.11%（上年度末：0.00%）。

#### 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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约

规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	99,033,917.71	-	-	-	-	-	99,033,917.71
结算备付金	39,364,360.44	-	-	-	-	-	39,364,360.44
存出保证金	400,955.38	-	-	-	-	4,885,584.00	5,286,539.38
交易性金融 资产	-	-	-	-	1,724,143.59	1,393,494,843.66	1,395,218,987.25
应收申购款	-	-	-	-	-	417,233.37	417,233.37
资产总计	138,799,233.53	-	-	-	1,724,143.59	1,398,797,661.03	1,539,321,038.15
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	443,214.04	443,214.04
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	2,153,431.08	2,153,431.08
应付托管费	-	-	-	-	-	358,905.21	358,905.21
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	7,092,998.43	7,092,998.43
应交税费	-	-	-	-	-	4.68	4.68
其他负债	-	-	-	-	-	5,442,407.26	5,442,407.26
负债总计	-	-	-	-	-	15,490,960.70	15,490,960.70
利率敏感度 缺口	138,799,233.53	-	-	-	1,724,143.59	-	-
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	29,280,457.86	-	-	-	-	-	29,280,457.86
结算备付金	2,485,449.52	-	-	-	-	-	2,485,449.52
存出保证金	316,290.19	-	-	-	-	-	316,290.19
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	479,660,016.70	479,660,016.70
应收申购款	-	-	-	-	-	166,612.93	166,612.93
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	3,765,276.40	3,765,276.40
资产总计	32,082,197.57	-	-	-	-	483,591,906.03	515,674,103.60
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,106,948.22	1,106,948.22
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	702,986.93	702,986.93

应付托管费	-	-	-	-	117,164.47	117,164.47
应付证券清算款	-	-	-	-	2,989,206.15	2,989,206.15
应交税费	-	-	-	-	3.05	3.05
其他负债	-	-	-	-	2,406,853.52	2,406,853.52
负债总计	-	-	-	-	7,323,162.34	7,323,162.34
利率敏感度缺口	32,082,197.57	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 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 0.11%（上年度末：0.00%），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）。

#### 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	1,393,494,843.66	91.45	479,660,016.70	94.36
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	1,393,494,843.66	91.45	479,660,016.70	94.36

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%	57,805,300.81	14,084,582.58
沪深 300 指数下降 5%	-57,805,300.81	-14,084,582.58	

#### 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	1,391,330,144.97	476,525,479.19
第二层次	2,378,827.49	1,469,297.52
第三层次	1,510,014.79	1,665,239.99
合计	1,395,218,987.25	479,660,016.70

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的

不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,393,494,843.66	90.53
	其中：股票	1,393,494,843.66	90.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,724,143.59	0.11
	其中：债券	1,724,143.59	0.11
	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	138,398,278.15	8.99
8	其他各项资产	5,703,772.75	0.37
9	合计	1,539,321,038.15	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	6,119,364.39	0.40
B	采矿业	23,129,431.00	1.52
C	制造业	944,072,670.22	61.95

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,664,866.47	2.14
E	建筑业	29,879,129.11	1.96
F	批发和零售业	29,953,289.55	1.97
G	交通运输、仓储和邮政业	12,821,873.00	0.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	183,054,791.04	12.01
J	金融业	28,687,604.16	1.88
K	房地产业	32,155,921.00	2.11
L	租赁和商务服务业	17,288,805.70	1.13
M	科学研究和技术服务业	21,371,396.16	1.40
N	水利、环境和公共设施管理业	4,857,857.00	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,818,346.86	0.12
R	文化、体育和娱乐业	22,890,637.00	1.50
S	综合	2,728,861.00	0.18
	合计	1,393,494,843.66	91.45

### 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	300777	中简科技	303,300	14,333,958.00	0.94
2	002402	和而泰	828,600	14,069,628.00	0.92
3	000528	柳工	1,733,085	13,691,371.50	0.90
4	603345	安井食品	89,000	13,065,200.00	0.86
5	002017	东信和平	963,016	12,625,139.76	0.83
6	002283	天润工业	1,912,800	12,280,176.00	0.81
7	002421	达实智能	3,409,300	12,000,736.00	0.79
8	002139	拓邦股份	909,569	11,869,875.45	0.78
9	600502	安徽建工	2,239,477	11,824,438.56	0.78
10	603027	千禾味业	548,700	11,588,544.00	0.76
11	000048	京基智农	588,413	11,485,821.76	0.75
12	002212	天融信	1,183,900	11,483,830.00	0.75
13	002335	科华数据	318,000	11,432,100.00	0.75
14	000951	中国重汽	664,500	11,196,825.00	0.73
15	300674	宇信科技	632,764	11,187,267.52	0.73
16	002215	诺普信	1,487,700	11,172,627.00	0.73
17	300109	新开源	446,400	11,101,968.00	0.73
18	600612	老凤祥	157,700	11,020,076.00	0.72
19	601137	博威合金	702,300	10,927,788.00	0.72

20	002396	星网锐捷	483,500	10,922,265.00	0.72
21	002649	博彦科技	767,300	10,841,949.00	0.71
22	002698	博实股份	618,800	10,822,812.00	0.71
23	601222	林洋能源	1,318,600	10,799,334.00	0.71
24	600789	鲁抗医药	1,678,100	10,773,402.00	0.71
25	002610	爱康科技	4,159,400	10,648,064.00	0.70
26	301039	中集车辆	804,554	10,644,249.42	0.70
27	300869	康泰医学	456,935	10,491,227.60	0.69
28	601619	嘉泽新能	2,295,000	10,442,250.00	0.69
29	300232	洲明科技	1,089,100	9,954,374.00	0.65
30	002815	崇达技术	781,637	9,731,380.65	0.64
31	002158	汉钟精机	383,822	9,580,197.12	0.63
32	002489	浙江永强	2,349,100	9,513,855.00	0.62
33	002126	银轮股份	527,000	9,327,900.00	0.61
34	688556	高测股份	173,301	9,209,215.14	0.60
35	600064	南京高科	1,390,700	9,192,527.00	0.60
36	600864	哈投股份	1,796,100	9,178,071.00	0.60
37	601908	京运通	1,508,672	9,127,465.60	0.60
38	600420	国药现代	779,168	8,796,806.72	0.58
39	300206	理邦仪器	576,900	8,699,652.00	0.57
40	600211	西藏药业	146,400	8,696,160.00	0.57
41	600531	豫光金铅	1,372,400	8,646,120.00	0.57
42	300773	拉卡拉	493,485	8,606,378.40	0.56
43	600073	上海梅林	1,176,600	8,589,180.00	0.56
44	603881	数据港	380,140	8,587,362.60	0.56
45	002517	恺英网络	544,500	8,570,430.00	0.56
46	600480	凌云股份	1,078,000	8,473,080.00	0.56
47	300123	亚光科技	1,132,600	8,245,328.00	0.54
48	002737	葵花药业	335,300	8,161,202.00	0.54
49	002768	国恩股份	335,700	8,120,583.00	0.53
50	002967	广电计量	395,100	7,937,559.00	0.52
51	600821	金开新能	1,146,400	7,898,696.00	0.52
52	600750	江中药业	359,750	7,889,317.50	0.52
53	600057	厦门象屿	898,851	7,820,003.70	0.51
54	002020	京新药业	598,700	7,675,334.00	0.50
55	002063	远光软件	883,643	7,670,021.24	0.50
56	601126	四方股份	501,600	7,619,304.00	0.50
57	002895	川恒股份	368,900	7,267,330.00	0.48
58	600210	紫江企业	1,361,700	7,244,244.00	0.48
59	000517	荣安地产	2,370,800	7,230,940.00	0.47
60	000913	钱江摩托	390,900	7,126,107.00	0.47
61	603466	风语筑	507,700	7,057,030.00	0.46
62	002237	恒邦股份	634,475	6,909,432.75	0.45



63	300352	北信源	1,367,300	6,891,192.00	0.45
64	600662	外服控股	1,198,300	6,854,276.00	0.45
65	603368	柳药集团	273,800	6,765,598.00	0.44
66	002597	金禾实业	278,800	6,579,680.00	0.43
67	000829	天音控股	716,779	6,479,682.16	0.43
68	300416	苏试试验	296,103	6,383,980.68	0.42
69	300638	广和通	279,560	6,340,420.80	0.42
70	000650	仁和药业	1,023,000	6,281,220.00	0.41
71	688508	芯朋微	108,224	6,275,909.76	0.41
72	603919	金徽酒	264,800	6,217,504.00	0.41
73	000915	华特达因	173,700	6,129,873.00	0.40
74	000921	海信家电	222,600	5,999,070.00	0.39
75	600267	海正药业	517,600	5,890,288.00	0.39
76	688711	宏微科技	100,721	5,876,063.14	0.39
77	605111	新洁能	134,560	5,856,051.20	0.38
78	002987	京北方	264,240	5,792,140.80	0.38
79	002617	露笑科技	728,934	5,743,999.92	0.38
80	600285	羚锐制药	350,658	5,631,567.48	0.37
81	300130	新国都	196,200	5,558,346.00	0.36
82	601929	吉视传媒	2,972,600	5,469,584.00	0.36
83	600633	浙数文化	336,900	5,461,149.00	0.36
84	600458	时代新材	454,800	5,453,052.00	0.36
85	300567	精测电子	57,100	5,433,065.00	0.36
86	603103	横店影视	320,500	5,397,220.00	0.35
87	600320	振华重工	1,441,232	5,375,795.36	0.35
88	002747	埃斯顿	188,000	5,264,000.00	0.35
89	002060	粤水电	799,400	5,260,052.00	0.35
90	000758	中色股份	1,089,300	5,141,496.00	0.34
91	002011	盾安环境	371,400	5,136,462.00	0.34
92	000560	我爱我家	1,842,000	4,881,300.00	0.32
93	300672	国科微	58,185	4,849,719.75	0.32
94	600635	大众公用	1,446,300	4,801,716.00	0.32
95	002611	东方精工	829,400	4,760,756.00	0.31
96	002085	万丰奥威	681,800	4,724,874.00	0.31
97	300900	广联航空	163,100	4,698,911.00	0.31
98	002706	良信股份	414,340	4,661,325.00	0.31
99	300973	立高食品	67,900	4,645,718.00	0.30
100	603301	振德医疗	155,700	4,611,834.00	0.30
101	601519	大智慧	641,100	4,590,276.00	0.30
102	002746	仙坛股份	580,900	4,577,492.00	0.30
103	300002	神州泰岳	324,900	4,548,600.00	0.30
104	600312	平高电气	365,200	4,524,828.00	0.30
105	002446	盛路通信	474,200	4,481,190.00	0.29

106	000860	顺鑫农业	129,000	4,346,010.00	0.29
107	600129	太极集团	72,700	4,324,923.00	0.28
108	300263	隆华科技	505,700	4,207,424.00	0.28
109	300065	海兰信	335,700	4,159,323.00	0.27
110	301087	可孚医疗	84,230	4,152,539.00	0.27
111	000567	海德股份	313,988	4,025,326.16	0.26
112	000848	承德露露	451,200	3,993,120.00	0.26
113	000928	中钢国际	408,516	3,942,179.40	0.26
114	688268	华特气体	48,448	3,911,207.04	0.26
115	002467	二六三	783,600	3,894,492.00	0.26
116	300693	盛弘股份	103,800	3,832,296.00	0.25
117	605009	豪悦护理	79,549	3,818,352.00	0.25
118	603690	至纯科技	107,964	3,761,465.76	0.25
119	300294	博雅生物	102,700	3,725,956.00	0.24
120	002324	普利特	258,891	3,694,374.57	0.24
121	600456	宝钛股份	108,800	3,681,792.00	0.24
122	002436	兴森科技	236,500	3,665,750.00	0.24
123	002413	雷科防务	676,800	3,539,664.00	0.23
124	300119	瑞普生物	198,600	3,535,080.00	0.23
125	300133	华策影视	485,200	3,440,068.00	0.23
126	603323	苏农银行	815,200	3,431,992.00	0.23
127	002106	莱宝高科	403,700	3,431,450.00	0.23
128	002416	爱施德	461,500	3,405,870.00	0.22
129	300666	江丰电子	49,085	3,335,816.60	0.22
130	603005	晶方科技	164,600	3,324,920.00	0.22
131	301095	广立微	39,600	3,272,940.00	0.21
132	003006	百亚股份	187,500	3,240,000.00	0.21
133	603566	普莱柯	138,988	3,231,471.00	0.21
134	300735	光弘科技	301,300	3,223,910.00	0.21
135	000735	罗牛山	488,900	3,197,406.00	0.21
136	601019	山东出版	346,900	3,181,073.00	0.21
137	000818	航锦科技	95,000	3,170,150.00	0.21
138	688019	安集科技	19,021	3,135,231.43	0.21
139	002636	金安国纪	338,200	3,121,586.00	0.20
140	603197	保隆科技	57,300	3,108,525.00	0.20
141	601567	三星医疗	243,300	3,072,879.00	0.20
142	688598	金博股份	17,900	3,069,850.00	0.20
143	300633	开立医疗	56,300	3,068,350.00	0.20
144	002918	蒙娜丽莎	198,700	3,067,928.00	0.20
145	000422	湖北宣化	264,900	3,041,052.00	0.20
146	601311	骆驼股份	322,400	2,991,872.00	0.20
147	002978	安宁股份	93,000	2,986,230.00	0.20
148	002123	梦网科技	220,500	2,930,445.00	0.19

149	000028	国药一致	67,100	2,926,231.00	0.19
150	002234	民和股份	160,459	2,921,958.39	0.19
151	600559	老白干酒	118,700	2,909,337.00	0.19
152	002859	洁美科技	103,600	2,869,720.00	0.19
153	688037	芯源微	16,785	2,869,395.75	0.19
154	600363	联创光电	77,000	2,856,700.00	0.19
155	001696	宗申动力	398,400	2,820,672.00	0.19
156	600577	精达股份	660,900	2,788,998.00	0.18
157	600197	伊力特	102,100	2,774,057.00	0.18
158	300226	上海钢联	84,896	2,750,630.40	0.18
159	002400	省广集团	571,500	2,748,915.00	0.18
160	688518	联赢激光	98,169	2,734,988.34	0.18
161	600770	综艺股份	484,700	2,728,861.00	0.18
162	600478	科力远	380,100	2,713,914.00	0.18
163	688018	乐鑫科技	20,855	2,707,396.10	0.18
164	002544	普天科技	117,900	2,699,910.00	0.18
165	300593	新雷能	116,800	2,675,888.00	0.18
166	600273	嘉化能源	283,000	2,665,860.00	0.17
167	688123	聚辰股份	49,542	2,661,396.24	0.17
168	300035	中科电气	220,800	2,654,016.00	0.17
169	300031	宝通科技	107,100	2,647,512.00	0.17
170	000950	重药控股	386,300	2,599,799.00	0.17
171	688707	振华新材	84,200	2,592,518.00	0.17
172	600323	瀚蓝环境	136,900	2,591,517.00	0.17
173	600639	浦东金桥	208,200	2,583,762.00	0.17
174	300131	英唐智控	488,800	2,566,200.00	0.17
175	601001	晋控煤业	274,100	2,565,576.00	0.17
176	002605	姚记科技	55,100	2,558,293.00	0.17
177	002130	沃尔核材	313,600	2,546,432.00	0.17
178	600483	福能股份	220,300	2,544,465.00	0.17
179	601965	中国汽研	123,200	2,544,080.00	0.17
180	688559	海目星	54,024	2,539,668.24	0.17
181	300451	创业慧康	302,900	2,538,302.00	0.17
182	600459	贵研铂业	165,385	2,530,390.50	0.17
183	600446	金证股份	173,300	2,519,782.00	0.17
184	300323	华灿光电	367,400	2,516,690.00	0.17
185	300525	博思软件	163,200	2,503,488.00	0.16
186	600552	凯盛科技	210,600	2,493,504.00	0.16
187	603212	赛伍技术	119,500	2,486,795.00	0.16
188	688425	铁建重工	513,600	2,470,416.00	0.16
189	000685	中山公用	326,200	2,469,334.00	0.16
190	600850	电科数字	104,400	2,462,796.00	0.16
191	000969	安泰科技	259,800	2,460,306.00	0.16

192	000555	神州信息	199,500	2,453,850.00	0.16
193	601369	陕鼓动力	269,300	2,453,323.00	0.16
194	603505	金石资源	105,000	2,451,750.00	0.16
195	688680	海优新材	20,000	2,436,400.00	0.16
196	300379	东方通	117,400	2,414,918.00	0.16
197	002635	安洁科技	174,900	2,413,620.00	0.16
198	002851	麦格米特	66,100	2,410,667.00	0.16
199	603018	华设集团	275,400	2,409,750.00	0.16
200	000403	派林生物	120,700	2,409,172.00	0.16
201	300613	富瀚微	42,400	2,405,776.00	0.16
202	600248	陕建股份	503,100	2,399,787.00	0.16
203	603306	华懋科技	82,600	2,397,052.00	0.16
204	300696	爱乐达	97,400	2,396,040.00	0.16
205	002194	武汉凡谷	219,100	2,394,763.00	0.16
206	600037	歌华有线	287,600	2,389,956.00	0.16
207	688578	艾力斯	88,000	2,371,600.00	0.16
208	688001	华兴源创	66,800	2,366,056.00	0.16
209	300102	乾照光电	359,100	2,362,878.00	0.16
210	603348	文灿股份	53,800	2,356,978.00	0.15
211	300382	斯莱克	177,900	2,346,501.00	0.15
212	600966	博汇纸业	396,300	2,346,096.00	0.15
213	688066	航天宏图	38,300	2,332,470.00	0.15
214	688127	蓝特光学	131,200	2,313,056.00	0.15
215	300134	大富科技	225,500	2,311,375.00	0.15
216	688526	科前生物	97,100	2,310,009.00	0.15
217	000603	盛达资源	190,700	2,305,563.00	0.15
218	688586	江航装备	165,000	2,295,150.00	0.15
219	300770	新媒股份	50,000	2,293,000.00	0.15
220	000881	中广核技	278,100	2,288,763.00	0.15
221	000688	国城矿业	150,800	2,287,636.00	0.15
222	000557	西部创业	433,900	2,286,653.00	0.15
223	002267	陕天然气	285,500	2,261,160.00	0.15
224	002549	凯美特气	196,400	2,258,600.00	0.15
225	600184	光电股份	172,000	2,258,360.00	0.15
226	601069	西部黄金	175,500	2,253,420.00	0.15
227	300377	赢时胜	277,200	2,245,320.00	0.15
228	600587	新华医疗	63,400	2,239,922.00	0.15
229	002651	利君股份	287,800	2,236,206.00	0.15
230	601528	瑞丰银行	460,460	2,233,231.00	0.15
231	300183	东软载波	134,900	2,227,199.00	0.15
232	603612	索通发展	127,800	2,214,774.00	0.15
233	300981	中红医疗	145,000	2,196,750.00	0.14
234	000761	本钢板材	548,800	2,195,200.00	0.14

235	688007	光峰科技	104,700	2,182,995.00	0.14
236	600984	建设机械	479,000	2,165,080.00	0.14
237	000737	北方铜业	400,800	2,160,312.00	0.14
238	603609	禾丰股份	235,900	2,146,690.00	0.14
239	603093	南华期货	196,300	2,137,707.00	0.14
240	000058	深赛格	337,400	2,085,132.00	0.14
241	605376	博迁新材	65,000	2,039,700.00	0.13
242	300203	聚光科技	100,200	2,031,054.00	0.13
243	600007	中国国贸	108,100	2,002,012.00	0.13
244	002929	润建股份	46,000	1,996,860.00	0.13
245	600729	重庆百货	63,400	1,993,296.00	0.13
246	688139	海尔生物	38,659	1,989,778.73	0.13
247	002941	新疆交建	127,600	1,975,248.00	0.13
248	000875	吉电股份	366,200	1,973,818.00	0.13
249	003040	楚天龙	108,800	1,973,632.00	0.13
250	600888	新疆众和	248,400	1,967,328.00	0.13
251	300827	上能电气	54,555	1,966,707.75	0.13
252	002233	塔牌集团	254,400	1,963,968.00	0.13
253	600641	万业企业	101,500	1,937,635.00	0.13
254	000923	河钢资源	142,900	1,929,150.00	0.13
255	605369	拱东医疗	34,200	1,916,568.00	0.13
256	300079	数码视讯	313,900	1,914,790.00	0.13
257	603300	华铁应急	341,300	1,860,085.00	0.12
258	300443	金雷股份	51,100	1,811,495.00	0.12
259	002453	华软科技	168,300	1,799,127.00	0.12
260	002044	美年健康	252,400	1,794,564.00	0.12
261	002214	大立科技	130,500	1,781,325.00	0.12
262	300755	华致酒行	79,100	1,777,377.00	0.12
263	002051	中工国际	147,200	1,756,096.00	0.12
264	300663	科蓝软件	128,900	1,751,751.00	0.11
265	603997	继峰股份	122,400	1,750,320.00	0.11
266	000811	冰轮环境	111,000	1,749,360.00	0.11
267	000801	四川九洲	236,800	1,728,640.00	0.11
268	603599	广信股份	62,700	1,697,916.00	0.11
269	600797	浙大网新	233,800	1,669,332.00	0.11
270	300811	铂科新材	28,040	1,666,697.60	0.11
271	688499	利元亨	26,200	1,664,224.00	0.11
272	601801	皖新传媒	177,100	1,662,969.00	0.11
273	603713	密尔克卫	18,400	1,639,256.00	0.11
274	002061	浙江交科	366,400	1,634,144.00	0.11
275	603032	德新科技	47,300	1,633,742.00	0.11
276	300101	振芯科技	82,300	1,595,797.00	0.10
277	002741	光华科技	94,400	1,593,472.00	0.10

278	300358	楚天科技	105,100	1,569,143.00	0.10
279	688131	皓元医药	27,400	1,561,252.00	0.10
280	600185	格力地产	225,600	1,547,616.00	0.10
281	600990	四创电子	48,900	1,547,196.00	0.10
282	600201	生物股份	159,700	1,518,747.00	0.10
283	600477	杭萧钢构	370,800	1,516,572.00	0.10
284	002100	天康生物	181,500	1,497,375.00	0.10
285	603236	移远通信	25,100	1,448,521.00	0.10
286	002641	公元股份	255,600	1,441,584.00	0.09
287	600977	中国电影	101,700	1,428,885.00	0.09
288	000682	东方电子	146,600	1,424,952.00	0.09
289	603636	南威软件	95,500	1,400,985.00	0.09
290	601975	招商南油	487,700	1,394,822.00	0.09
291	002541	鸿路钢构	48,100	1,385,761.00	0.09
292	000061	农产品	228,700	1,369,913.00	0.09
293	603718	海利生物	145,000	1,367,350.00	0.09
294	300687	赛意信息	48,300	1,341,774.00	0.09
295	000917	电广传媒	179,400	1,311,414.00	0.09
296	688233	神工股份	41,200	1,301,096.00	0.09
297	300260	新莱应材	32,620	1,289,142.40	0.08
298	688356	键凯科技	11,800	1,257,290.00	0.08
299	600557	康缘药业	45,600	1,252,176.00	0.08
300	301089	拓新药业	20,100	1,244,994.00	0.08
301	688091	上海谊众	16,900	1,244,347.00	0.08
302	688110	东芯股份	34,446	1,243,500.60	0.08
303	600550	保变电气	242,500	1,222,200.00	0.08
304	603328	依顿电子	146,600	1,213,848.00	0.08
305	600583	海油工程	206,600	1,208,610.00	0.08
306	002782	可立克	78,900	1,206,381.00	0.08
307	002695	煌上煌	112,000	1,197,280.00	0.08
308	002807	江阴银行	324,200	1,196,298.00	0.08
309	601208	东材科技	92,600	1,176,020.00	0.08
310	300762	上海瀚讯	99,200	1,167,584.00	0.08
311	300768	迪普科技	70,100	1,161,557.00	0.08
312	600572	康恩贝	168,700	1,155,595.00	0.08
313	300820	英杰电气	13,950	1,149,201.00	0.08
314	600773	西藏城投	90,900	1,145,340.00	0.08
315	002287	奇正藏药	47,900	1,144,810.00	0.08
316	002135	东南网架	175,200	1,131,792.00	0.07
317	300428	立中集团	47,800	1,102,268.00	0.07
318	688733	壹石通	35,300	1,092,888.00	0.07
319	603567	珍宝岛	71,600	1,071,136.00	0.07
320	688575	亚辉龙	56,800	1,047,960.00	0.07

321	688266	泽璟制药	22,500	1,047,375.00	0.07
322	002612	朗姿股份	42,400	1,008,272.00	0.07
323	300233	金城医药	52,500	998,025.00	0.07
324	688298	东方生物	26,315	992,601.80	0.07
325	002839	张家港行	231,600	979,668.00	0.06
326	300068	南都电源	50,600	979,616.00	0.06
327	300327	中颖电子	34,800	973,008.00	0.06
328	688235	百济神州	8,600	938,346.00	0.06
329	600710	苏美达	108,625	929,830.00	0.06
330	603801	志邦家居	28,100	927,862.00	0.06
331	002344	海宁皮城	194,500	919,985.00	0.06
332	600206	有研新材	69,800	917,172.00	0.06
333	002961	瑞达期货	63,500	915,035.00	0.06
334	601677	明泰铝业	65,500	909,140.00	0.06
335	688161	威高骨科	20,700	896,517.00	0.06
336	600986	浙文互联	139,000	889,600.00	0.06
337	603098	森特股份	42,400	869,200.00	0.06
338	002675	东诚药业	57,000	838,470.00	0.06
339	300170	汉得信息	72,100	832,034.00	0.05
340	000030	富奥股份	164,300	828,072.00	0.05
341	688261	东微半导	5,889	823,694.43	0.05
342	603733	仙鹤股份	39,200	817,320.00	0.05
343	688568	中科星图	9,900	797,742.00	0.05
344	600006	东风汽车	134,300	793,713.00	0.05
345	300054	鼎龙股份	29,900	739,427.00	0.05
346	002038	双鹭药业	72,900	735,561.00	0.05
347	300747	锐科激光	24,000	731,520.00	0.05
348	002314	南山控股	221,200	729,960.00	0.05
349	600158	中体产业	71,200	723,392.00	0.05
350	600882	妙可蓝多	32,300	719,644.00	0.05
351	600649	城投控股	181,900	714,867.00	0.05
352	688389	普门科技	28,500	669,465.00	0.04
353	002891	中宠股份	27,400	661,436.00	0.04
354	000885	城发环境	48,600	646,866.00	0.04
355	600490	鹏欣资源	162,700	598,736.00	0.04
356	300737	科顺股份	64,000	586,240.00	0.04
357	600872	中炬高新	15,600	573,924.00	0.04
358	688608	恒玄科技	4,600	556,738.00	0.04
359	600776	东方通信	37,300	531,525.00	0.03
360	603308	应流股份	28,700	525,210.00	0.03
361	688315	诺禾致源	19,600	520,380.00	0.03
362	002332	仙琚制药	38,600	511,450.00	0.03
363	002317	众生药业	30,000	509,700.00	0.03

364	002979	雷赛智能	21,200	503,712.00	0.03
365	300485	赛升药业	47,900	490,017.00	0.03
366	688399	硕世生物	8,500	469,200.00	0.03
367	688085	三友医疗	16,200	425,412.00	0.03
368	605168	三人行	4,900	421,106.00	0.03
369	300738	奥飞数据	40,900	417,180.00	0.03
370	001308	康冠科技	15,000	411,900.00	0.03
371	600993	马应龙	13,900	386,559.00	0.03
372	688525	佰维存储	4,614	368,612.46	0.02
373	688696	极米科技	2,600	362,414.00	0.02
374	002701	奥瑞金	76,200	343,662.00	0.02
375	300653	正海生物	9,900	340,461.00	0.02
376	002023	海特高新	35,800	329,360.00	0.02
377	603208	江山欧派	8,900	324,138.00	0.02
378	301327	华宝新能	3,800	300,618.00	0.02
379	688321	微芯生物	12,700	287,528.00	0.02
380	000049	德赛电池	8,000	282,240.00	0.02
381	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.02
382	600172	黄河旋风	64,200	274,776.00	0.02
383	601028	玉龙股份	25,200	270,900.00	0.02
384	688502	茂莱光学	1,509	269,492.31	0.02
385	603229	奥翔药业	12,100	253,858.00	0.02
386	301219	腾远钴业	6,300	235,368.00	0.02
387	600761	安徽合力	11,800	235,174.00	0.02
388	002558	巨人网络	12,000	215,160.00	0.01
389	600284	浦东建设	33,900	207,468.00	0.01
390	688318	财富趋势	2,040	203,938.80	0.01
391	300623	捷捷微电	10,300	186,636.00	0.01
392	000652	泰达股份	43,700	180,044.00	0.01
393	300332	天壕环境	15,600	178,932.00	0.01
394	300910	瑞丰新材	2,900	145,870.00	0.01
395	000006	深振业 A	32,200	140,714.00	0.01
396	688699	明微电子	2,600	130,832.00	0.01
397	002664	信质集团	9,200	129,536.00	0.01
398	000756	新华制药	6,000	129,480.00	0.01
399	002677	浙江美大	12,200	129,198.00	0.01
400	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
401	301216	万凯新材	6,200	103,106.00	0.01
402	688082	盛美上海	925	102,120.00	0.01
403	002488	金固股份	14,700	101,430.00	0.01
404	688072	拓荆科技	237	100,954.89	0.01
405	688249	晶合集成	5,578	100,738.68	0.01
406	300604	长川科技	2,100	99,729.00	0.01



407	688596	正帆科技	2,281	98,767.30	0.01
408	688630	芯碁微装	1,160	97,463.20	0.01
409	688200	华峰测控	628	96,084.00	0.01
410	605020	永和股份	3,700	95,497.00	0.01
411	300602	飞荣达	6,100	94,489.00	0.01
412	003031	中瓷电子	700	93,184.00	0.01
413	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.01
414	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
415	688120	华海清科	305	76,875.25	0.01
416	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
417	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
418	301031	中熔电气	500	67,855.00	0.00
419	300662	科锐国际	1,800	63,666.00	0.00
420	688472	阿特斯	3,624	61,752.96	0.00
421	603393	新天然气	2,200	59,048.00	0.00
422	688469	中芯集成	10,447	56,518.27	0.00
423	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
424	600223	福瑞达	4,800	49,248.00	0.00
425	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
426	688531	日联科技	283	38,479.51	0.00
427	688033	天宜上佳	2,000	38,240.00	0.00
428	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
429	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
430	688146	中船特气	760	28,978.80	0.00
431	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
432	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
433	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
434	301358	湖南裕能	661	28,350.29	0.00
435	300319	麦捷科技	3,100	26,536.00	0.00
436	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
437	001287	中电港	1,154	24,257.08	0.00
438	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
439	300151	昌红科技	1,300	23,530.00	0.00
440	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
441	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
442	301322	绿通科技	384	20,444.16	0.00
443	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
444	601061	中信金属	2,547	19,306.26	0.00
445	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
446	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
447	300685	艾德生物	700	16,982.00	0.00
448	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
449	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00

450	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
451	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
452	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
453	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
454	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
455	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
456	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
457	002405	四维图新	1,200	13,896.00	0.00
458	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
459	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
460	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
461	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
462	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
463	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
464	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
465	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
466	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
467	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
468	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
469	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
470	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
471	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
472	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
473	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
474	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
475	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
476	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
477	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
478	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
479	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
480	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
481	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
482	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
483	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
484	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
485	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
486	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
487	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
488	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
489	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
490	688148	芳源股份	39	475.80	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	002597	金禾实业	36,092,688.94	7.10
2	301039	中集车辆	35,835,265.54	7.05
3	601137	博威合金	31,236,011.00	6.14
4	600797	浙大网新	28,929,064.00	5.69
5	603118	共进股份	28,502,606.00	5.61
6	600420	国药现代	28,083,123.63	5.52
7	600073	上海梅林	28,045,737.00	5.52
8	300777	中简科技	27,978,873.00	5.50
9	600850	电科数字	26,923,107.00	5.30
10	300232	洲明科技	25,948,502.00	5.10
11	002139	拓邦股份	25,319,078.58	4.98
12	600572	康恩贝	25,129,413.00	4.94
13	000758	中色股份	25,005,300.00	4.92
14	002421	达实智能	24,158,731.00	4.75
15	605388	均瑶健康	24,098,995.25	4.74
16	002402	和而泰	23,810,432.00	4.68
17	000933	神火股份	23,696,361.00	4.66
18	002126	银轮股份	23,555,847.94	4.63
19	002044	美年健康	23,403,428.00	4.60
20	600502	安徽建工	23,165,875.50	4.56
21	002518	科士达	22,656,530.12	4.46
22	300036	超图软件	22,589,482.67	4.44
23	002237	恒邦股份	22,552,184.25	4.44
24	600750	江中药业	22,282,674.85	4.38
25	000555	神州信息	22,072,490.00	4.34
26	601908	京运通	21,971,344.00	4.32
27	002463	沪电股份	21,882,525.00	4.30
28	002610	爱康科技	21,822,327.00	4.29
29	603027	千禾味业	21,790,069.00	4.29
30	301219	腾远钴业	21,760,382.08	4.28
31	002158	汉钟精机	21,616,849.46	4.25
32	002697	红旗连锁	21,439,431.00	4.22
33	600458	时代新材	21,001,476.00	4.13
34	600483	福能股份	20,790,889.46	4.09
35	300352	北信源	20,678,890.00	4.07
36	300118	东方日升	20,655,027.00	4.06
37	600789	鲁抗医药	20,499,173.00	4.03
38	300119	瑞普生物	20,395,991.79	4.01
39	605111	新洁能	20,335,608.60	4.00

40	002017	东信和平	20,136,422.15	3.96
41	002063	远光软件	20,059,089.53	3.95
42	601126	四方股份	19,732,481.00	3.88
43	002517	恺英网络	19,215,771.00	3.78
44	600210	紫江企业	18,807,199.00	3.70
45	002746	仙坛股份	18,653,221.40	3.67
46	600057	厦门象屿	18,631,309.75	3.67
47	000517	荣安地产	18,575,072.00	3.65
48	300674	宇信科技	18,529,332.87	3.64
49	688556	高测股份	18,428,738.22	3.63
50	000423	东阿阿胶	18,227,802.02	3.59
51	600481	双良节能	18,057,729.20	3.55
52	002865	钧达股份	18,029,164.41	3.55
53	000893	亚钾国际	17,939,155.00	3.53
54	000048	京基智农	17,808,764.77	3.50
55	300856	科思股份	17,798,928.03	3.50
56	002649	博彦科技	17,734,379.69	3.49
57	000528	柳工	17,704,452.20	3.48
58	002851	麦格米特	17,634,794.50	3.47
59	601222	林洋能源	17,475,777.00	3.44
60	603368	柳药集团	17,443,678.57	3.43
61	601619	嘉泽新能	17,433,192.00	3.43
62	000917	电广传媒	17,255,783.96	3.39
63	300775	三角防务	17,170,087.00	3.38
64	300900	广联航空	17,153,835.00	3.37
65	603345	安井食品	17,151,864.00	3.37
66	002449	国星光电	17,033,068.69	3.35
67	605589	圣泉集团	17,028,217.00	3.35
68	002215	诺普信	16,854,760.00	3.32
69	002747	埃斯顿	16,824,216.00	3.31
70	000915	华特达因	16,738,492.00	3.29
71	002979	雷赛智能	16,729,544.90	3.29
72	600612	老凤祥	16,701,951.00	3.29
73	688399	硕世生物	16,462,187.54	3.24
74	002768	国恩股份	16,454,974.28	3.24
75	002283	天润工业	16,135,953.00	3.17
76	600662	外服控股	16,044,839.00	3.16
77	300109	新开源	16,044,578.67	3.16
78	002038	双鹭药业	15,951,101.24	3.14
79	600761	安徽合力	15,868,265.06	3.12
80	603301	振德医疗	15,781,655.00	3.10
81	601686	友发集团	15,753,687.12	3.10
82	300130	新国都	15,748,086.00	3.10

83	300872	天阳科技	15,688,804.80	3.09
84	000951	中国重汽	15,512,398.72	3.05
85	000567	海德股份	15,496,500.42	3.05
86	600211	西藏药业	15,451,635.00	3.04
87	300080	易成新能	15,429,696.00	3.04
88	000650	仁和药业	15,089,226.00	2.97
89	600285	羚锐制药	15,078,656.00	2.97
90	002335	科华数据	15,047,414.00	2.96
91	601921	浙版传媒	15,020,921.00	2.95
92	002020	京新药业	14,968,884.00	2.94
93	600158	中体产业	14,941,014.00	2.94
94	600748	上实发展	14,871,398.00	2.93
95	600864	哈投股份	14,745,787.00	2.90
96	300226	上海钢联	14,638,332.00	2.88
97	002212	天融信	14,616,900.00	2.88
98	002967	广电计量	14,553,760.98	2.86
99	688516	奥特维	14,468,222.08	2.85
100	603690	至纯科技	14,460,120.56	2.84
101	002291	遥望科技	14,389,655.00	2.83
102	300638	广和通	14,298,072.60	2.81
103	002222	福晶科技	14,262,138.00	2.81
104	300662	科锐国际	14,069,107.60	2.77
105	002276	万马股份	14,005,947.35	2.76
106	002123	梦网科技	13,997,849.00	2.75
107	002698	博实股份	13,989,862.77	2.75
108	002437	誉衡药业	13,946,613.00	2.74
109	688066	航天宏图	13,941,933.42	2.74
110	600267	海正药业	13,855,226.00	2.73
111	002233	塔牌集团	13,803,278.00	2.72
112	600370	三房巷	13,788,730.00	2.71
113	002782	可立克	13,519,767.40	2.66
114	300298	三诺生物	13,516,861.00	2.66
115	002318	久立特材	13,156,183.00	2.59
116	300842	帝科股份	13,043,614.00	2.57
117	300765	新诺威	12,983,526.42	2.55
118	601519	大智慧	12,967,108.00	2.55
119	000928	中钢国际	12,941,222.88	2.55
120	600105	永鼎股份	12,889,337.35	2.54
121	603103	横店影视	12,876,400.00	2.53
122	600120	浙江东方	12,819,656.83	2.52
123	600559	老白干酒	12,758,239.00	2.51
124	300762	上海瀚讯	12,737,185.60	2.51
125	300315	掌趣科技	12,694,944.00	2.50

126	002240	盛新锂能	12,642,986.00	2.49
127	600876	凯盛新能	12,589,188.00	2.48
128	600821	金开新能	12,574,813.00	2.47
129	603236	移远通信	12,478,498.25	2.45
130	002839	张家港行	12,458,716.00	2.45
131	688018	乐鑫科技	12,452,056.26	2.45
132	605009	豪悦护理	12,436,303.82	2.45
133	002567	唐人神	12,427,853.00	2.44
134	600908	无锡银行	12,410,933.00	2.44
135	002737	葵花药业	12,389,045.00	2.44
136	000913	钱江摩托	12,384,607.00	2.44
137	002079	苏州固锔	12,335,191.39	2.43
138	002396	星网锐捷	12,325,299.00	2.42
139	002605	姚记科技	12,296,728.00	2.42
140	688707	振华新材	12,292,278.77	2.42
141	000860	顺鑫农业	12,272,188.10	2.41
142	300382	斯莱克	12,271,925.00	2.41
143	002895	川恒股份	12,221,071.00	2.40
144	300596	利安隆	12,196,396.00	2.40
145	002727	一心堂	12,167,250.54	2.39
146	600320	振华重工	12,137,366.10	2.39
147	603919	金徽酒	12,056,947.00	2.37
148	300439	美康生物	11,997,091.00	2.36
149	002006	精工科技	11,992,684.00	2.36
150	600531	豫光金铅	11,912,381.00	2.34
151	300348	长亮科技	11,882,202.00	2.34
152	688508	芯朋微	11,880,578.00	2.34
153	600933	爱柯迪	11,712,790.00	2.30
154	002061	浙江交科	11,624,315.32	2.29
155	000612	焦作万方	11,561,824.40	2.27
156	600971	恒源煤电	11,560,012.00	2.27
157	002324	普利特	11,486,150.54	2.26
158	300101	振芯科技	11,457,945.52	2.25
159	300869	康泰医学	11,418,612.55	2.25
160	300123	亚光科技	11,370,840.00	2.24
161	000921	海信家电	11,325,670.15	2.23
162	300031	宝通科技	11,323,791.50	2.23
163	300438	鹏辉能源	11,297,574.00	2.22
164	300236	上海新阳	11,224,138.00	2.21
165	002489	浙江永强	11,186,856.00	2.20
166	600064	南京高科	11,040,496.21	2.17
167	300567	精测电子	11,007,462.00	2.17
168	002413	雷科防务	10,971,916.00	2.16

169	600480	凌云股份	10,938,398.60	2.15
170	601975	招商南油	10,857,753.00	2.14
171	002918	蒙娜丽莎	10,847,150.00	2.13
172	000546	ST金圆	10,811,662.00	2.13
173	300773	拉卡拉	10,781,364.35	2.12
174	605369	拱东医疗	10,765,668.40	2.12
175	603612	索通发展	10,764,710.00	2.12
176	002815	崇达技术	10,755,287.51	2.12
177	603466	风语筑	10,705,206.00	2.11
178	000600	建投能源	10,676,450.00	2.10
179	600583	海油工程	10,625,506.00	2.09
180	600456	宝钛股份	10,585,293.00	2.08
181	688711	宏微科技	10,525,032.42	2.07
182	002611	东方精工	10,510,765.00	2.07
183	603881	数据港	10,478,462.84	2.06
184	601567	三星医疗	10,371,411.00	2.04
185	300803	指南针	10,366,510.00	2.04
186	603718	海利生物	10,288,401.69	2.02
187	688559	海目星	10,177,174.16	2.00

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	603118	共进股份	35,284,395.65	6.94
2	002597	金禾实业	34,722,978.70	6.83
3	002463	沪电股份	32,904,296.50	6.47
4	301039	中集车辆	31,879,969.84	6.27
5	000933	神火股份	28,391,293.39	5.58
6	002697	红旗连锁	28,027,625.00	5.51
7	600797	浙大网新	27,399,555.00	5.39
8	000758	中色股份	27,360,165.00	5.38
9	600572	康恩贝	25,761,415.00	5.07
10	300352	北信源	25,479,677.76	5.01
11	600850	电科数字	23,974,428.02	4.72
12	300036	超图软件	23,671,076.89	4.66
13	002276	万马股份	23,569,457.00	4.64
14	605388	均瑶健康	23,466,082.00	4.62
15	000917	电广传媒	23,412,759.00	4.61
16	600073	上海梅林	23,291,327.00	4.58
17	600481	双良节能	22,762,228.00	4.48
18	002044	美年健康	22,721,366.00	4.47
19	601137	博威合金	22,340,725.00	4.39
20	002518	科士达	22,088,034.98	4.35

21	301219	腾远钴业	21,757,110.40	4.28
22	600750	江中药业	20,824,797.50	4.10
23	300119	瑞普生物	20,640,311.08	4.06
24	002291	遥望科技	19,930,818.14	3.92
25	000423	东阿阿胶	19,915,235.00	3.92
26	600210	紫江企业	19,589,204.00	3.85
27	002517	恺英网络	19,511,154.00	3.84
28	300856	科思股份	19,336,130.50	3.80
29	600420	国药现代	19,291,509.00	3.79
30	300900	广联航空	19,286,256.83	3.79
31	002865	钧达股份	19,169,778.58	3.77
32	600971	恒源煤电	19,091,920.00	3.76
33	000555	神州信息	18,693,663.80	3.68
34	300775	三角防务	18,572,610.00	3.65
35	600158	中体产业	18,567,813.00	3.65
36	000517	荣安地产	18,487,418.00	3.64
37	300118	东方日升	18,459,251.40	3.63
38	300130	新国都	18,024,225.80	3.55
39	002139	拓邦股份	17,935,671.00	3.53
40	600761	安徽合力	17,803,068.65	3.50
41	601908	京运通	17,785,656.00	3.50
42	605589	圣泉集团	17,543,401.00	3.45
43	002449	国星光电	17,448,546.98	3.43
44	002222	福晶科技	17,404,660.85	3.42
45	601921	浙版传媒	17,210,145.00	3.39
46	000893	亚钾国际	16,867,895.98	3.32
47	300842	帝科股份	16,723,096.00	3.29
48	600284	浦东建设	16,723,053.19	3.29
49	600105	永鼎股份	16,470,454.24	3.24
50	600559	老白干酒	16,454,922.00	3.24
51	600285	羚锐制药	16,418,026.00	3.23
52	300872	天阳科技	16,374,224.74	3.22
53	002649	博彦科技	16,372,506.83	3.22
54	600483	福能股份	16,169,046.48	3.18
55	300232	洲明科技	16,077,136.38	3.16
56	002662	京威股份	15,992,798.38	3.15
57	603368	柳药集团	15,988,748.80	3.15
58	002038	双鹭药业	15,962,885.00	3.14
59	002851	麦格米特	15,958,620.00	3.14
60	002610	爱康科技	15,759,354.00	3.10
61	300765	新诺威	15,635,218.50	3.08
62	000915	华特达因	15,555,419.49	3.06
63	601686	友发集团	15,492,220.28	3.05



64	600458	时代新材	15,479,926.00	3.05
65	600748	上实发展	15,218,972.00	2.99
66	000600	建投能源	15,213,555.00	2.99
67	688516	奥特维	15,141,512.83	2.98
68	688399	硕世生物	15,020,757.83	2.95
69	603690	至纯科技	14,960,279.80	2.94
70	002158	汉钟精机	14,756,350.00	2.90
71	300080	易成新能	14,707,669.00	2.89
72	300662	科锐国际	14,664,206.40	2.88
73	002237	恒邦股份	14,546,520.00	2.86
74	002979	雷赛智能	14,537,968.35	2.86
75	002126	银轮股份	14,498,350.00	2.85
76	600057	厦门象屿	14,436,015.45	2.84
77	000612	焦作万方	14,204,668.05	2.79
78	300226	上海钢联	14,081,318.75	2.77
79	300777	中简科技	13,870,681.15	2.73
80	300315	掌趣科技	13,695,956.00	2.69
81	002839	张家港行	13,648,127.00	2.68
82	002567	唐人神	13,597,672.00	2.67
83	300438	鹏辉能源	13,532,837.00	2.66
84	300377	赢时胜	13,502,263.96	2.66
85	002746	仙坛股份	13,468,945.20	2.65
86	600370	三房巷	13,429,010.00	2.64
87	002318	久立特材	13,173,769.00	2.59
88	601126	四方股份	13,151,579.00	2.59
89	300298	三诺生物	12,981,116.48	2.55
90	000567	海德股份	12,815,693.60	2.52
91	600120	浙江东方	12,776,944.54	2.51
92	002437	誉衡药业	12,766,710.00	2.51
93	002605	姚记科技	12,662,975.00	2.49
94	600502	安徽建工	12,601,833.80	2.48
95	002182	云海金属	12,542,818.21	2.47
96	002063	远光软件	12,540,786.00	2.47
97	000546	ST金圆	12,539,349.00	2.47
98	002747	埃斯顿	12,437,786.48	2.45
99	300101	振芯科技	12,304,875.64	2.42
100	605111	新洁能	12,304,235.20	2.42
101	688066	航天宏图	12,198,845.90	2.40
102	600908	无锡银行	12,173,911.00	2.39
103	002079	苏州固锔	11,994,499.00	2.36
104	300236	上海新阳	11,968,332.00	2.35
105	300348	长亮科技	11,921,313.65	2.35
106	300762	上海瀚讯	11,894,236.00	2.34

107	002020	京新药业	11,811,626.40	2.32
108	002240	盛新锂能	11,764,107.00	2.31
109	688556	高测股份	11,675,354.77	2.30
110	603920	世运电路	11,660,502.00	2.29
111	002727	一心堂	11,622,893.00	2.29
112	603529	爱玛科技	11,596,996.81	2.28
113	002055	得润电子	11,541,483.00	2.27
114	002233	塔牌集团	11,514,741.00	2.27
115	600933	爱柯迪	11,482,594.00	2.26
116	300439	美康生物	11,388,809.00	2.24
117	603960	克来机电	11,335,468.70	2.23
118	002174	游族网络	11,293,018.46	2.22
119	300596	利安隆	11,247,278.50	2.21
120	688707	振华新材	11,203,641.06	2.20
121	002402	和而泰	11,177,662.00	2.20
122	300634	彩讯股份	11,162,347.75	2.20
123	000034	神州数码	11,087,775.00	2.18
124	000928	中钢国际	11,070,952.08	2.18
125	688148	芳源股份	10,896,471.53	2.14
126	300639	凯普生物	10,880,928.93	2.14
127	002036	联创电子	10,874,093.00	2.14
128	003009	中天火箭	10,869,601.45	2.14
129	600876	凯盛新能	10,827,161.67	2.13
130	002123	梦网科技	10,806,951.00	2.13
131	002421	达实智能	10,800,091.00	2.12
132	688018	乐鑫科技	10,756,381.35	2.12
133	002993	奥海科技	10,729,500.00	2.11
134	002006	精工科技	10,681,161.99	2.10
135	600685	中船防务	10,678,535.00	2.10
136	000913	钱江摩托	10,497,412.00	2.06
137	002837	英维克	10,441,856.11	2.05

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	4,739,881,707.44
卖出股票收入（成交）总额	3,872,561,783.75

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	-	-
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）	1,724,143.59	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,724,143.59	0.11

### 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	127086	恒邦转债	17,240	1,724,143.59	0.11

### 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。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。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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在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	5,286,539.38
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	417,233.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,703,772.75

### 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

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 (%)
77,760	14,373.72	920,445,567.59	82.35	197,254,705.45	17.65

## 8.2 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	73,505.03	0.006576

## 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

- 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、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年2月6日）基金份额总额	1,784,551,427.10
本报告期期初基金份额总额	335,576,804.15
本报告期基金总申购份额	880,328,147.02
减：本报告期基金总赎回份额	98,204,678.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,117,700,273.04

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

本基金本报告期末更换会计师事务所。

## 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 (%)	
华创证券有限责任公司	1	834,314,067.76	9.70	776,995.01	9.70	-
光大证券股份有限公司	2	832,169,239.55	9.68	775,009.69	9.68	-
天风证券股份有限公司	1	807,989,733.85	9.40	752,474.71	9.40	-
长江证券股份有限公司	1	780,797,938.28	9.08	727,160.49	9.08	-
中信建投证券股份有限公司	2	684,867,413.39	7.96	637,823.08	7.96	-
东方证券股份有限公司	1	660,380,960.50	7.68	615,014.59	7.68	-
华金证券股份有限公司	2	611,582,602.11	7.11	569,572.91	7.11	-
中泰证券股份有限公司	2	592,138,224.17	6.89	551,466.60	6.89	-
中信证券股份有限公司	4	550,077,201.29	6.40	512,291.64	6.40	-
渤海证券股份有限公司	1	541,690,206.50	6.30	504,482.17	6.30	-
西部证券股份有限公司	2	534,359,933.63	6.21	497,647.99	6.21	-
招商证券股份有限公司	1	427,056,985.81	4.97	397,716.33	4.97	-
东北证券股份有限公司	1	258,305,139.24	3.00	240,565.94	3.00	-
广发证券股份有限公司	1	217,825,078.44	2.53	202,864.24	2.53	-
国信证券股份	2	175,174,164.04	2.04	163,141.90	2.04	-

有限公司						
东方财富证券股份有限公司	2	36,372,257.69	0.42	33,876.60	0.42	-
安信证券股份有限公司	1	28,289,048.03	0.33	26,344.41	0.33	-
长城证券股份有限公司	2	25,576,562.31	0.30	23,819.84	0.30	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

2、本基金本期交易单元未发生变更。

### 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	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

		的比例 (%)				(%)
华创证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	87,073.80	2.24	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券 股份有限 公司	821,573.98	21.14	-	-	-	-
华金证券 股份有限 公司	2,557,845.25	65.83	-	-	-	-
中泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
西部证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	419,302.54	10.79	-	-	-	-



国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 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	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 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	关于旗下部分基金新增平安银行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 2 月 3 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 10 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 2 月 24 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	2023 年 3 月 25 日
7	景顺长城量化小盘股票型证券投资基	中国证监会指定报刊及	2023 年 3 月 28 日

	金 2022 年年度报告	网站	
8	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
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	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 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	关于旗下部分基金新增中国光大银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 28 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 6 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 13 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增德邦证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 26 日
18	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 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 5 月 26 日
19	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 26 日
20	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
21	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
22	关于旗下部分基金新增杭州银行股份有限公司杭 e 家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 6 月 16 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 17 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增开源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 20 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 22 日

26	关于景顺长城量化小盘股票型证券投资基金暂停接受伍佰万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 27 日
27	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 27 日
28	关于景顺长城量化小盘股票型证券投资基金恢复接受伍佰万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告	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	20230526-20230630	0.00	338,056,296.85	19,426,126.68	318,630,170.17	28.51
	2	20230101-20230119	70,406,087.12	23,668,047.33	0.00	94,074,134.45	8.42
	3	20230131-20230630	0.00	376,402,379.21	0.00	376,402,379.21	33.68
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</p> <p>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</p>							

投资中出现的各类风险。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

### 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