

# 景顺长城大中华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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 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.....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
<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 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	39

7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	39
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	42
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	43
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	44
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	44
7.11 投资组合报告附注 .....	44
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</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 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城大中华混合型证券投资基金	
基金简称	景顺长城大中华混合（QDII）	
基金主代码	262001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 9 月 22 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	700,548,700.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城大中华混合（QDII）A	景顺长城大中华混合（QDII）C
下属分级基金的交易代码	262001	016988
报告期末下属分级基金的份 额总额	694,710,623.02 份	5,838,077.70 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于除内地以外的大中华地区证券市场以及海外证券市场交易的大中华企业，追求长期资本增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的资产配置与“自下而上”的选股相结合的投资策略，在实际投资组合的构建上更偏重“自下而上”的部分，重点投资于处于合理价位的成长型股票（Growth at Reasonable Price, GARP）以及受惠于盈利周期加速且估值便宜的品质型股票（value + catalyst）。
业绩比较基准	摩根斯坦利金龙净总收益指数（MSCI Golden Dragon Net Total Return Index）。
风险收益特征	本基金是混合型基金，属于高预期风险、高预期收益的投资品种。其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。同时，本基金投资的目标市场是海外市场，除了需要承担市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、不同地区以及国别风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	郭明
	联系电话	0755-82370388	(010) 66105799
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755-22381339	(010) 66105798
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 55 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里	北京市西城区复兴门内大街 55

	建设广场第一座 21 层	号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	李进	陈四清

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Invesco Hong Kong Limited	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	景顺投资管理有限公司	渣打银行（香港）有限公司
注册地址		香港中环花园道三号冠君大厦 41 楼	香港中环德辅道中四至四 A 渣打银行大厦三十二楼
办公地址		香港中环花园道三号冠君大厦 41 楼	香港九龙官塘道 388 号渣打中心十五楼
邮政编码		-	-

## 2.5 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

## 2.6 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)	
	景顺长城大中华混合（QDII）A	景顺长城大中华混合（QDII）C
本期已实现收益	6,558,066.81	-32,980.69
本期利润	-64,463,745.00	-842,061.95
加权平均基金份额本期利润	-0.0924	-0.2063
本期加权平均净值利润率	-4.91%	-11.03%
本期基金份额净值增长率	-4.41%	-4.47%
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	-44,341,656.03	-398,749.24
期末可供分配基金份额利润	-0.0638	-0.0683

期末基金资产净值	1,248,173,702.39	10,476,569.56
期末基金份额净值	1.797	1.795
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	131.75%	3.88%

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三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城大中华混合（QDII）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	5.71%	1.17%	3.19%	1.20%	2.52%	-0.03%
过去三个月	-5.22%	1.08%	-5.16%	0.99%	-0.06%	0.09%
过去六个月	-4.41%	1.31%	0.93%	1.20%	-5.34%	0.11%
过去一年	-4.72%	1.53%	-8.48%	1.52%	3.76%	0.01%
过去三年	-5.98%	1.64%	-9.37%	1.48%	3.39%	0.16%
自基金合同生效起至今	131.75%	1.21%	84.52%	1.23%	47.23%	-0.02%

景顺长城大中华混合（QDII）C

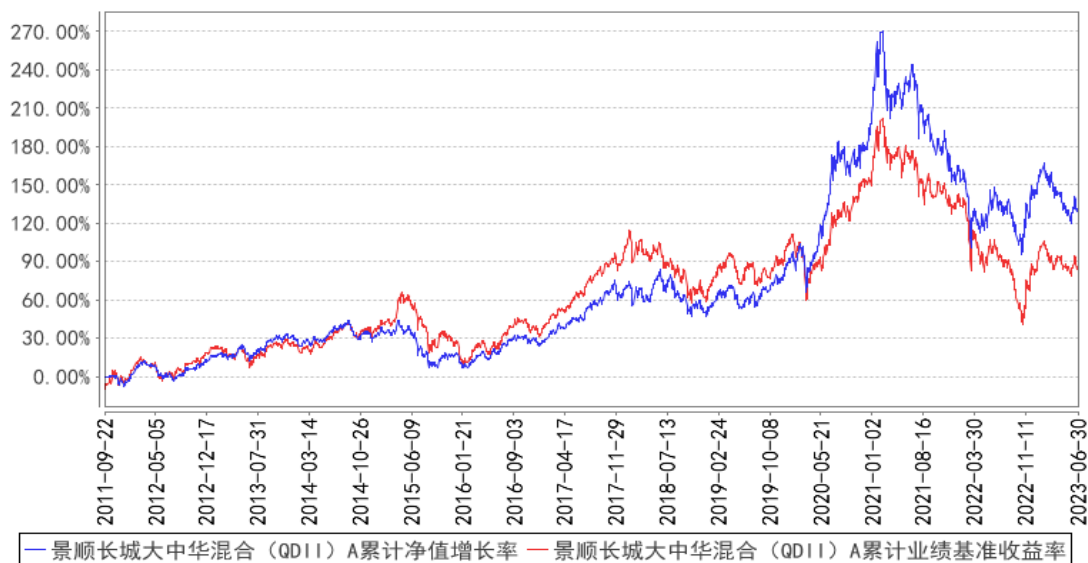
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.71%	1.17%	3.19%	1.20%	2.52%	-0.03%
过去三个月	-5.18%	1.07%	-5.16%	0.99%	-0.02%	0.08%
过去六个月	-4.47%	1.30%	0.93%	1.20%	-5.40%	0.10%

自基金合同生效起至今	3.88%	1.46%	18.74%	1.46%	-14.86%	0.00%
------------	-------	-------	--------	-------	---------	-------

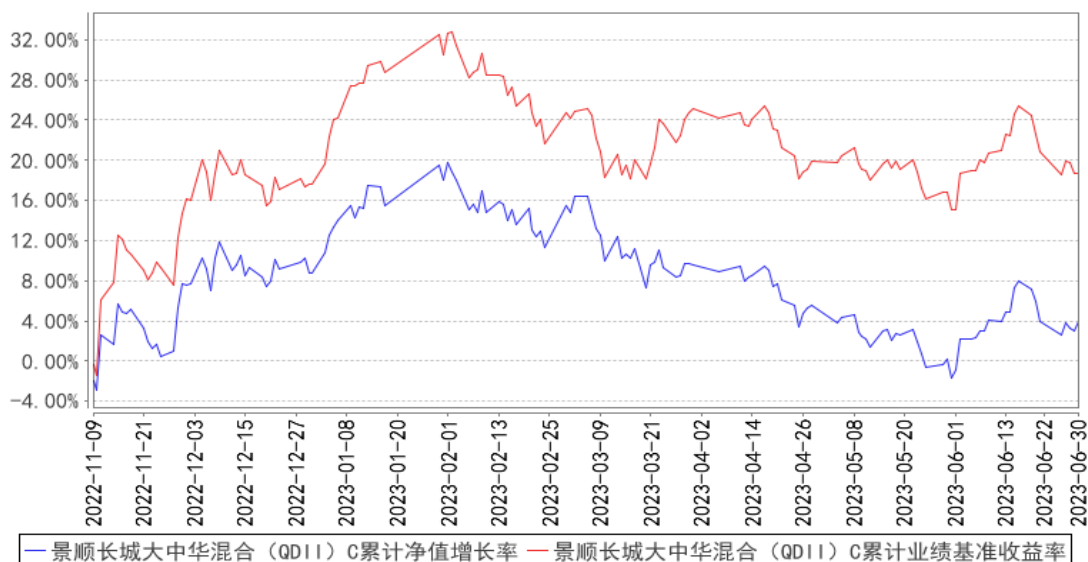
注：本基金自 2022 年 11 月 8 日起增设以人民币为单位进行销售和计价的 C 类基金份额，并于 2022 年 11 月 9 日开始对 C 类基金份额进行估值。

### 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

景顺长城大中华混合（QDII）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



景顺长城大中华混合（QDII）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：本基金的资产配置比例为：股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的 60%，其中投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及在其他证券市场交易的大中华企业的资产不低于基金股票及其他权益类资产的 80%；持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2011 年 9 月 22 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 2020 年 12 月 8 日起增设 A 类美元基金份额。本基金自 2022 年 11 月 8 日起增设以人民币为单位进行销售和计价的 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		
周寒颖	本基金的基金经理	2016 年 6 月 3 日	-	17 年	工商管理硕士。曾任招商基金研究部研究员、高级研究员、国际业务部高级研究员。2015 年 7 月加入本公司，担任研究部高级研究员，自 2016 年 6 月起担任国际投资部基金经理。具有 17 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
萧 光 一 (MikeShiao)	首席投资总监	31	美国宾夕法尼亚州卓克索大学（Drexel University）金融理学硕士。2002 年加盟景顺，并于 2015 年出任大中华首席投资总监，带领大中华区股票团队，并于 2016 年 4 月担任亚洲区（日本除外）的首席投资总监。萧先生自 2008 年起已为景顺大中华基金的首席基金经理，并于 2014 年 7 月起担任亚洲机遇股票投资组合的首席基金经理。他同时负责中国智选股票等投资组合，以及投资于中国香港/大陆的机构客户投资组合。在此之前，萧先生为中国台湾景顺投信的股票部主管，其后于 2006 年加入位于中国香港的景顺投资管理有限公司，以拓展其覆盖至大中华市场。萧先生在 1992 年开始投身投资业界，在 Grand Regent Investment Ltd. 担任项目经理达六年之久，管理中国台湾及大陆的创业基金的活动。他于 1997 年加盟 Overseas Credit and Securities Inc.，担任高级分析员，负责研究中国台湾的科技板块。萧先生亦曾于 Taiwan International Investment Management Co. 担任基金经理，负责科技业的研究工作。

#### 4.3 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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城大中华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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 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。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，恒生指数下跌 4.4%，上证指数上涨 3.65%，中国台湾加权指数上涨 19.65%。同期，纳斯达克指数上涨 31.73%，标普 500 上涨 15.91%。上半年，人民币兑美元贬值 3.21%， 二季末离岸市场人民币对美金汇率 7.26。二季度大中华基金收益率跑输业绩基准，主要是由于低配中国台湾市场、超配港股市场所致。

上半年台股跟随美股走势，反应 AI 产业链景气度上行，对应的 AI 需求拉动服务器、散热和 PCB 等板块，股票估值从市盈率 10 倍上涨到 15 倍附近。AI 主题在港股反应并不充分，从大模型到游戏阅读应用到通信龙头，涨幅比 A 股和台股要少很多。大中华基金在港股上增持通信龙头取得收益，但不能弥补低配中国台湾资讯科技股带来的损失。基金经理将在接下来的时间加强中国台湾市场研究，以备在后续的市场调整中选出业绩受益的标的增强组合回报。同时，基金经理对港股部分做出相应调整，调整医药生物和机械设备个股、加仓汽车、运动服饰和能源，维持通信和传媒权重，减仓部分中特估标的。

海外方面，美国通胀及就业持续超市场预期，显示经济仍具韧性。核心 CPI 通胀居高不下，其中住房部门是推高美国核心通胀的主要因素。劳动力市场表现强劲，美联储激进加息尚未对劳动力市场产生实际影响，一方面货币紧缩的传导有滞后性，另一方面显示美国劳动力的结构性问题（低端劳动力对利率敏感性较低）。据此，市场不断上修美联储加息预期，根据 6 月末芝加哥期货交易所显示，当前 7 月份美国加息 25 基点的概率升至 71%，全年降息概率为 0。在强势美元以及国内基本面边际走弱的背景下，人民币汇率持续承压，海外资金持续流出港股市场。具体从资金面来看，随着人民币贬值，市场波动加大，南下资金流入速度有所放缓。南下资金 4、5 月份流入回落，6 月份净流入为年内新低。海外资金方面，主动型基金从 4 月份以来持续流出港股市场，但被动型基金 5 月份以来持续流入。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年上半年，景顺长城大中华混合基金 A 类份额净值增长率为-4.41%，业绩比较基准收益率为 0.93%。

2023 年上半年，景顺长城大中华混合基金 C 类份额净值增长率为-4.47%，业绩比较基准收益率为 0.93%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为下半年出口产业链和出行产业链存在预期差，市场预期不高，但实际可能继续超预期。背后逻辑是疫情结束后全球出行等服务性需求共振拉动消费、区域一体化供应链重塑背景下的制造业和基建投资加速，导致通胀走高-工资上升-需求上升，无论是美国还是日本还是东南亚各国，都出现这种不同于以往经验的现象。从海外收入占比高的上市公司相关调研数据来看，具有共同性，引发我们对区域一体化的投资机会思考。下半年我们仍会持续研究该现象的持续性以及相关的投资机会。

经过 6 月回调，港股估值已经跌破去年历史低位，恒生指数动态 PE 再次回到过去十年负 1 倍标准差水平，已经部分反应国内弱复苏预期，中长期布局价值凸显。持续关注国内经济走势。参考全球资金配置经验，今年以来，全球的“哑铃型”配置（日本高股息资产+纳指龙头-AI 互联网）超额收益明显。在分子、分母均承压的背景下，持续看好高分红加成长的“哑铃型”策略，以应对市场变化，争取给投资者稳健回报。首先，关注高分红、低估值、资本开支少且 ROE 有望提升的央国企。其次，聚焦 TMT，关注数字经济及 AI 赋能行业变革等结构性投资机会。最后，从中期维度出发，关注股价超跌弹性品种，包括基本面稳健的互联网、部分消费品，如家电、运动服饰、医疗服务等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的

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

相关定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：景顺长城大中华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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	249,173,635.85	139,041,054.00
结算备付金		181.27	312.36
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,015,613,125.46	1,081,132,745.44
其中：股票投资		1,015,613,125.46	1,081,132,745.44
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	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		-	30,835,695.18
应收股利		6,258,040.68	553,212.12
应收申购款		754,319.43	905,996.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,271,799,302.69	1,252,469,015.12
<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		7,514,494.88	3,798,263.54
应付赎回款		3,153,248.01	1,833,380.71

应付管理人报酬		1,866,606.64	1,907,054.04
应付托管费		362,951.28	370,816.08
应付销售服务费		3,403.08	495.49
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	248,326.85	368,490.34
负债合计		13,149,030.74	8,278,500.20
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	700,548,700.72	661,976,412.72
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	558,101,571.23	582,214,102.20
净资产合计		1,258,650,271.95	1,244,190,514.92
负债和净资产总计		1,271,799,302.69	1,252,469,015.12

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 700,548,700.72 份，其中景顺长城大中华混合（QDII）A（人民币）基金份额净值 1.797 元，基金份额 690,613,919.23 份；景顺长城大中华混合（QDII）A（美元现汇）基金份额净值 0.249 元，基金份额 4,096,703.79 份；景顺长城大中华（QDII）C 基金份额净值 1.795 元，基金份额 5,838,077.70 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城大中华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
<b>一、营业总收入</b>		-50,972,021.86	-69,086,289.65
1. 利息收入		124,217.05	179,465.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	124,217.05	179,465.26
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）		15,078,445.64	-164,888,756.89
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,536,400.85	-184,132,164.48
基金投资收益	6.4.7.15	-	-

债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	135,244.54	-
股利收益	6.4.7.20	16,479,601.95	19,243,407.59
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）	6.4.7.21	-71,830,893.07	89,575,027.07
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		5,546,503.06	5,856,110.83
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.22	109,705.46	191,864.08
<b>减：二、营业总支出</b>		14,333,785.09	11,755,965.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,816,363.85	9,729,178.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,297,626.32	1,891,784.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	14,412.09	-
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	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		488.53	-
8. 其他费用	6.4.7.24	204,894.30	135,002.30
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		-65,305,806.95	-80,842,254.74
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		-65,305,806.95	-80,842,254.74
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-65,305,806.95	-80,842,254.74

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城大中华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	未分配利润	净资产合计



		合收益		
一、上期期末净资产（基金净值）	661,976,412.72	-	582,214,102.20	1,244,190,514.92
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）	661,976,412.72	-	582,214,102.20	1,244,190,514.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	38,572,288.00	-	-24,112,530.97	14,459,757.03
（一）、综合收益总额	-	-	-65,305,806.95	-65,305,806.95
（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）	38,572,288.00	-	41,193,275.98	79,765,563.98
其中：1. 基金申购款	108,541,759.78	-	102,505,948.15	211,047,707.93
2. 基金赎回款	-69,969,471.78	-	-61,312,672.17	-131,282,143.95
（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）	700,548,700.72	-	558,101,571.23	1,258,650,271.95
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）	596,968,770.58	-	604,084,507.59	1,201,053,278.17
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	596,968,770.58	-	604,084,507.59	1,201,053,278.17

产（基金净值）				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,629,612.45	-	-77,728,882.63	-80,358,495.08
（一）、综合收益总额	-	-	-80,842,254.74	-80,842,254.74
（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）	-2,629,612.45	-	3,113,372.11	483,759.66
其中：1. 基金申购款	110,294,160.45	-	91,059,837.14	201,353,997.59
2. 基金赎回款	-112,923,772.90	-	-87,946,465.03	-200,870,237.93
（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）	594,339,158.13	-	526,355,624.96	1,120,694,783.09

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

景顺长城大中华混合型证券投资基金(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[2011]第 709 号《关于核准景顺长城大中华股票型证券投资基金募集的批复》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《景顺长城大中华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 291,060,560.03 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 367 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺

长城大中华股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 291,092,562.55 份基金份额，其中认购资金利息折合 32,002.52 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为渣打银行(香港)有限公司(StandardCharteredBank(HongKong)Limited)。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，景顺长城大中华股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 5 日公告后更名为景顺长城大中华混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城大中华混合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股票及其他权益类证券、现金、债券、股指期货及中国证监会允许投资的其它金融工具。本基金对于股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的 60%，其中投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及在其他证券市场交易的大中华企业的资产不低于基金股票及其他权益类资产的 80%；持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例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。本基金的业绩比较基准为：摩根斯坦利金龙净总收益指数(MSCI GoldenDragonNetTotalReturnIndex)。

根据本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2020 年 12 月 8 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城大中华混合型证券投资基金增设美元基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告》和更新后的《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》，自 2020 年 12 月 8 日起，本基金根据申购、赎回所使用货币的不同，在现有人民币基金份额的基础上增设美元基金份额，原有基金份额将自动划归为本基金人民币基金份额。本基金以人民币计价并进行申购、赎回的份额类别，称为人民币基金份额；以美元计价并进行申购、赎回的份额类别，称为美元基金份额。本基金对人民币基金份额和美元基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值和基金份额累计净值。人民币基金份额和美元基金份额合并投资运作，共同承担投资换汇产生的费用及其他相关费用。投资者在申购基金份额时可自行选择基金份额类别，并交付相应币种的款项。

根据本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2022 年 11 月 8 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城大中华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部分条款的公告》，自 2022 年 11 月 8 日起，本基金在现有基金份额的基础上增设以人民币为单位进行销售和计价的 C 类基金份额，原人民币基金份额(基金代码：262001)转为 A 类人民币基金份额、原美元基金份额(基金代码：010671)转为 A 类美元基金份额。根据更新后的《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额，A 类基金份额包括 A 类人民币基金份额和 A 类美元现汇基金份额；在投资者

申购时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额，C 类基金份额仅设 C 类人民币基金份额。本基金各类基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。

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[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[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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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(如适用)起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) 目前基金取得的其他源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。对基金通过沪港通或深港通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) 基金通过沪港通或深港通买卖、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	249,173,635.85
等于：本金	249,165,967.70
加：应计利息	7,668.15
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	249,173,635.85

注：于 2023 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 160,091,829.54 元（折合人民币 147,601,465.00 元），美元 1,031,664.78 元（折合人民币 7,454,603.36 元），新台币 135,275,389.00 元（折合人民币 31,375,518.58 元）。

#### 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	1,023,071,278.31	-	1,015,613,125.46	-7,458,152.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,023,071,278.31	-	1,015,613,125.46	-7,458,152.85

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

**6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

无。

**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	5,348.25
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	120,084.63
其中：交易所市场	120,084.63
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	122,893.97
合计	248,326.85

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 景顺长城大中华混合（QDII）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	660,895,357.89	660,895,357.89
本期申购	97,214,560.71	97,214,560.71
本期赎回（以“-”号填列）	-63,399,295.58	-63,399,295.58
本期末	694,710,623.02	694,710,623.02

##### 景顺长城大中华混合（QDII）C

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	1,081,054.83	1,081,054.83
本期申购	11,327,199.07	11,327,199.07
本期赎回（以“-”号填列）	-6,570,176.20	-6,570,176.20
本期末	5,838,077.70	5,838,077.70

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

##### 景顺长城大中华混合（QDII）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-49,969,946.31	631,234,330.04	581,264,383.73
本期利润	6,558,066.81	-71,021,811.81	-64,463,745.00
本期基金份额交易产生的变动数	-929,776.53	37,592,217.17	36,662,440.64
其中：基金申购款	-4,119,488.08	96,107,081.84	91,987,593.76
基金赎回款	3,189,711.55	-58,514,864.67	-55,325,153.12



本期已分配利润	-	-	-
本期末	-44,341,656.03	597,804,735.40	553,463,079.37

## 景顺长城大中华混合（QDII）C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-82,806.10	1,032,524.57	949,718.47
本期利润	-32,980.69	-809,081.26	-842,061.95
本期基金份额交易产生的变动数	-282,962.45	4,813,797.79	4,530,835.34
其中：基金申购款	-543,813.84	11,062,168.23	10,518,354.39
基金赎回款	260,851.39	-6,248,370.44	-5,987,519.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-398,749.24	5,037,241.10	4,638,491.86

## 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	109,555.20
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	14,490.48
其他	171.37
合计	124,217.05

## 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	-1,536,400.85
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	-1,536,400.85

## 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	1,161,792,600.49
减：卖出股票成本总额	1,158,379,030.42
减：交易费用	4,949,970.92
买卖股票差价收入	-1,536,400.85

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

## 6.4.7.16 债券投资收益

## 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

## 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.18 贵金属投资收益

## 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.19 衍生工具收益

## 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出权证成交总额	139,774.84
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	459.19
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	4,071.11
买卖权证差价收入	135,244.54

## 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.20 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	16,479,601.95
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	16,479,601.95

#### 6.4.7.21 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	-71,830,893.07
股票投资	-71,830,893.07
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	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-71,830,893.07

#### 6.4.7.22 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	109,705.46
合计	109,705.46

#### 6.4.7.23 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.24 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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	392.00
其他	67,832.84
税务代理费	13,222.90

证券组合费	14,350.62
合计	204,894.30

#### 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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
渣打银行（香港）有限公司（“渣打银行（香港）”）	境外资产托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺长城资产管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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	-	-	35,374,405.90	1.37

###### 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	-	-	-	-
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	28,300.06	1.11	28,300.06	11.00

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 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	11,816,363.85	9,729,178.18
其中：支付销售机构的客户维护费	2,625,079.52	2,524,977.54

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.80%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.80\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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托管费	2,297,626.32	1,891,784.61

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.35%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.35\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	景顺长城大中华混合 (QDII) A	景顺长城大中华混合 (QDII) C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	346.24	346.24
工商银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	346.24	346.24

注：自 2022 年 11 月 8 日起，本基金在现有基金份额的基础上增设以人民币为单位进行销售和计价的 C 类基金份额，原人民币基金份额(基金代码：262001)转为 A 类人民币基金份额、原美元基金份额(基金代码：010671)转为 A 类美元基金份额。

支付基金销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

#### 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

份额单位：份

景顺长城大中华混合（QDII）A

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例 (%)

景顺长城资产管理(深圳)有限公司	6,258,606.65	0.9000	6,258,606.65	0.9500
------------------	--------------	--------	--------------	--------

注：景顺长城资产管理(深圳)有限公司本报告期末持有的本基金份额为 A 类基金份额，持有的基金份额占比为占 A 类基金总份额的比例(上年度末：同)。

#### 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
渣打银行-活期	179,583,096.78	7,685.33	87,932,992.62	5,859.14
中国工商银行-活期	69,590,539.07	101,869.87	63,155,187.58	155,158.91

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人渣打银行保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内无利润分配。

#### 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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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发行的证券，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：同）。

### 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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
<b>资产</b>							
银行存款	217,185,170.58	-	-	-	-	31,988,465.27	249,173,635.85
结算备付金	181.27	-	-	-	-	-	181.27
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,015,613,125.46	1,015,613,125.46
应收股利	-	-	-	-	-	6,258,040.68	6,258,040.68
应收申购款	4,974.82	-	-	-	-	749,344.61	754,319.43
<b>资产总计</b>	<b>217,190,326.67</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,054,608,976.02</b>	<b>1,271,799,302.69</b>
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,153,248.01	3,153,248.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,866,606.64	1,866,606.64
应付托管费	-	-	-	-	-	362,951.28	362,951.28
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7,514,494.88	7,514,494.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,403.08	3,403.08
其他负债	-	-	-	-	-	248,326.85	248,326.85
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>13,149,030.74</b>	<b>13,149,030.74</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>217,190,326.67</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
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
<b>资产</b>							
银行存款	114,017,097.72	-	-	-	-	25,023,956.28	139,041,054.00
结算备付金	312.36	-	-	-	-	-	312.36
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,081,132,745.44	1,081,132,745.44
应收股利	-	-	-	-	-	553,212.12	553,212.12

应收申购款	1,099.86	-	-	-	904,896.16	905,996.02
应收证券清算款	-	-	-	-	30,835,695.18	30,835,695.18
资产总计	114,018,509.94	-	-	-	1,138,450,505.18	1,252,469,015.12
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	1,833,380.71	1,833,380.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,907,054.04	1,907,054.04
应付托管费	-	-	-	-	370,816.08	370,816.08
应付证券清算款	-	-	-	-	3,798,263.54	3,798,263.54
应付销售服务费	-	-	-	-	495.49	495.49
其他负债	-	-	-	-	368,490.34	368,490.34
负债总计	-	-	-	-	8,278,500.20	8,278,500.20
利率敏感度缺口	114,018,509.94	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有债券资产（上年度末：同），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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	7,454,603.36	147,601,465.00	31,375,518.58	186,431,586.94
交易性金融资产	89,687,662.09	819,582,765.91	106,342,697.46	1,015,613,125.46
应收股利	-	3,639,379.57	446,917.35	4,086,296.92
资产合计	97,142,265.45	970,823,610.48	138,165,133.39	1,206,131,009.32
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	7,514,426.59	-	7,514,426.59
其他负债	13,798.03	-	-	13,798.03
负债合计	13,798.03	7,514,426.59	-	7,528,224.62
资产负债表外汇风险敞口净额	97,128,467.42	963,309,183.89	138,165,133.39	1,198,602,784.70

项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	9,375,132.90	69,890,196.00	24,433,166.53	103,698,495.43
交易性金融资产	133,505,961.18	862,556,256.34	85,070,527.92	1,081,132,745.44
应收股利	-	-	412,074.06	412,074.06
应收申购款	1,390.69	-	-	1,390.69
应收证券清算款	30,835,695.18	-	-	30,835,695.18
资产合计	173,718,179.95	932,446,452.34	109,915,768.51	1,216,080,400.80
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	2,525,788.93	-	2,525,788.93
负债合计	-	2,525,788.93	-	2,525,788.93
资产负债表外汇风险敞口净额	173,718,179.95	929,920,663.41	109,915,768.51	1,213,554,611.87

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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）
	所有外币相对人民币 升值 5%	59,930,139.24	60,677,730.59
	所有外币相对人民币 贬值 5%	-59,930,139.24	-60,677,730.59

#### 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	1,015,613,125.46	80.69	1,081,132,745.44	86.89
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	1,015,613,125.46	80.69	1,081,132,745.44	86.89

## 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%	68,623,362.03	67,277,452.13
	沪深 300 指数下降 5%	-68,623,362.03	-67,277,452.13

## 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, 015, 613, 125. 46	1, 081, 132, 745. 44
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	1, 015, 613, 125. 46	1, 081, 132, 745. 44

#### 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, 015, 613, 125. 46	79. 86
	其中：普通股	925, 925, 463. 37	72. 80
	存托凭证	89, 687, 662. 09	7. 05
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	249,173,817.12	19.59
8	其他各项资产	7,012,360.11	0.55
9	合计	1,271,799,302.69	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 313,405,950.79 元，占基金资产净值比例为 24.90%。

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	819,582,765.91	65.12
中国台湾	106,342,697.46	8.45
美国	89,687,662.09	7.13
合计	1,015,613,125.46	80.69

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
周期性消费品	118,248,761.56	9.39
非周期性消费品	194,875,817.46	15.48
综合	-	-
能源	48,233,568.10	3.83
金融	36,470,578.46	2.90
基金	-	-
工业	111,762,754.90	8.88
信息技术	118,870,416.58	9.44
公用事业	-	-
通讯	387,151,228.40	30.76
合计	1,015,613,125.46	80.69

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序	公司名称（英	公司名称	证券代码	所在证券	所属	数量(股)	公允价值	占基
---	--------	------	------	------	----	-------	------	----

号	文)	(中文)		市场	国家 (地区)			金资 产净 值比 例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	354,800	108,472,495.93	8.62
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台积电	2330 TT	台湾证券交易所	中国台湾	796,000	106,342,697.46	8.45
3	CHINA MOBILE LTD	中国移动	941 HK	香港联合交易所	中国香港	1,138,500	67,231,634.44	5.34
4	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 HK	香港联合交易所	中国香港	2,105,600	60,957,482.16	4.84
5	Yadea Group Holdings LTD	雅迪控股	01585 HS	深港通联合市场	中国香港	3,488,000	57,306,736.40	4.55
6	PINDUODUO INC-ADR	拼多多	PDD US	纳斯达克证券交易所	美国	109,791	54,850,684.63	4.36
7	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	微创医疗	853 HK	香港联合交易所	中国香港	4,002,700	52,256,196.34	4.15
8	Morimatsu International Holdings	森松国际	2155 HK	香港联合交易所	中国香港	8,178,000	48,481,894.19	3.85
9	CNOOC LTD	中国海洋石油	883 HK	香港联合交易所	中国香港	4,671,000	48,233,568.10	3.83
10	MEITUAN DIANPING	美团点评	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	324,510	36,591,148.55	2.91
11	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港交易所	388 HK	深港通联合市场	中国香港	134,000	36,470,578.46	2.90
12	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	华润啤酒	291 HK	香港联合交易所	中国香港	748,000	35,585,477.66	2.83
13	CSSC Offshore and Marine Engineering company LTD	中船防务	317 HK	香港联合交易所	中国香港	3,104,000	32,624,815.49	2.59
14	New Oriental Education &	新东方教育科技集	9901 HK	香港联合交易所	中国香港	876,300	24,843,880.53	1.97



	Technology Group	团						
14	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	新东方教育科技集团	EDU US	纽约证券交易所	美国	21,174	6,041,934.03	0.48
15	LI NING CO LTD	李宁	2331 HK	香港联合交易所	中国香港	756,500	29,398,692.22	2.34
16	CHINA TELECOM CORP LTD	中国电信	728 HK	香港联合交易所	中国香港	7,248,000	25,059,416.40	1.99
17	Gushengtang Holdings Ltd	固生堂	2273 HK	香港联合交易所	中国香港	471,300	21,596,099.95	1.72
18	CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS	中教控股	839 HK	深港通联合市场	中国香港	3,460,000	19,459,309.88	1.55
19	GIANT BIOGENE	巨子生物	2367 HK	香港联合交易所	中国香港	590,800	18,955,761.28	1.51
20	Chervon Holdings Ltd	泉峰控股	2285 HK	香港联合交易所	中国香港	627,700	17,940,532.23	1.43
21	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	纽约证券交易所	美国	27,010	16,267,324.31	1.29
22	Hygeia Healthcare Holdings Co	海吉亚医疗	6078 HK	香港联合交易所	中国香港	412,800	16,137,157.79	1.28
23	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	申洲国际	2313 HK	香港联合交易所	中国香港	194,400	13,397,660.17	1.06
24	Dongfang Electric Corp Ltd	东方电气	1072 HK	香港联合交易所	中国香港	1,376,400	12,715,512.99	1.01
25	NETEASE.COM INC-ADR	网易	NTES US	纳斯达克证券交易所	美国	17,931	12,527,719.12	1.00
26	MAOYAN ENTERTAINMENT	猫眼娱乐	1896 HK	深港通联合市场	中国香港	1,838,800	12,155,565.03	0.97
27	Bosideng International Holding	波司登	3998 HK	深港通联合市场	中国香港	3,096,000	9,419,685.26	0.75
28	GEELY	吉利汽车	175 HK	香港联合交易所	中国	990,000	8,725,987.51	0.69

	AUTOMOBILE HOLDINGS LT			交易所	香港			
29	CHINA LITERATURE LTD	阅文集团	772 HK	香港联合交易所	中国香港	183,200	5,565,476.95	0.44

注：本基金对以上证券代码采用彭博代码即 BB Ticker。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	92,095,070.59	7.40
1	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	65,327,487.42	5.25
2	CNOOC LTD	883 HK	71,631,853.46	5.76
3	ZTE CORP-H	763 HK	58,470,254.98	4.70
4	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	49,767,725.51	4.00
5	CHINA TELECOM CORP LTD-H	728 HK	49,081,645.64	3.94
6	MEITUAN DIANPING	3690 HK	43,482,147.15	3.49
7	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	40,690,453.94	3.27
8	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	762 HK	38,677,108.01	3.11
9	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	31,914,923.53	2.57
10	Genscript Biotech Corp	1548 HK	30,741,219.36	2.47
11	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	29,414,123.26	2.36
12	PINDUODUO INC-ADR	PDD US	28,773,150.61	2.31
13	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	291 HK	28,763,832.76	2.31
14	LI NING CO LTD	2331 HK	28,311,400.92	2.28
15	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	26,205,301.61	2.11
16	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	EDU US	20,659,050.69	1.66
16	New Oriental Education & Technology Group Inc	9901 HK	5,502,332.21	0.44
17	CHINA MOBILE LTD	941 HK	24,916,381.95	2.00
18	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	24,116,682.46	1.94
19	雅迪控股	01585 HS	21,140,611.61	1.70
20	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1658 HK	21,068,243.79	1.69

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。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	----------	------	----------	----------------

1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	76,344,640.21	6.14
1	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	61,597,367.51	4.95
2	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	72,527,448.56	5.83
3	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	EDU US	53,517,457.27	4.30
3	New Oriental Education & Technology Group Inc	9901 HK	13,312,140.51	1.07
4	MEITUAN DIANPING	3690 HK	61,656,683.91	4.96
5	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	762 HK	59,418,720.97	4.78
6	CNOOC LTD	883 HK	58,660,480.73	4.71
7	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	47,122,673.50	3.79
8	ZHUZHOU CRRCTIMES ELECTRI-H	3898 HK	47,036,893.85	3.78
9	Genscript Biotech Corp	1548 HK	45,715,231.37	3.67
10	KE HOLDINGS INC	BEKE US	33,328,890.02	2.68
11	GIANT BIOGENE	2367 HK	30,139,804.92	2.42
12	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	29,586,468.75	2.38
13	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2330 TT	26,126,718.78	2.10
14	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	25,387,293.42	2.04
15	PINDUODUO INC-ADR	PDD US	24,748,883.96	1.99
16	LI NING CO LTD	2331 HK	23,024,118.41	1.85
17	CRRCT Corp Ltd	1766 HK	21,133,484.70	1.70
18	CHINA TELECOM CORP LTD-H	728 HK	20,216,144.81	1.62
19	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1658 HK	20,102,479.38	1.62
20	BYD CO LTD-H	1211 HK	19,962,840.04	1.60

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。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,159,473,423.73
卖出收入（成交）总额	1,161,792,600.49

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细**

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

**7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

本基金本报告期末未持有基金投资。

**7.11 投资组合报告附注****7.11.1 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。

**7.11.2 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。

**7.11.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	6,258,040.68
4	应收利息	-
5	应收申购款	754,319.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,012,360.11

**7.11.4 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。

**7.11.5 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。

**7.11.6 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 (%)
景顺长城大 中华混合 (QDII) A	100,570	6,907.73	307,823,802.53	44.31	386,886,820.49	55.69
景顺长城大 中华混合 (QDII) C	853	6,844.17	4,010,279.53	68.69	1,827,798.17	31.31
合计	101,423	6,907.20	311,834,082.06	44.51	388,714,618.66	55.49

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	景顺长城大中华混合（QDII）A	796,509.20	0.115333
	景顺长城大中华混合（QDII）C	100,346.28	1.718824
	合计	896,855.48	0.128022

## 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	景顺长城大中华混合（QDII）A	—
	景顺长城大中华混合（QDII）C	—
	合计	—
本基金基金经理持有 本开放式基金	景顺长城大中华混合（QDII）A	—
	景顺长城大中华混合（QDII）C	10~50
	合计	10~50

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城大中华混合（QDII）A	景顺长城大中华混合（QDII）C
基金合同生效日（2011年9月22日）基金份额总额	291,092,562.55	—
本报告期期初基金份额总额	660,895,357.89	1,081,054.83
本报告期基金总申购份额	97,214,560.71	11,327,199.07
减：本报告期基金总赎回份额	63,399,295.58	6,570,176.20
本报告期基金拆分变动份额	—	—

本报告期末基金份额总额	694,710,623.02	5,838,077.70
-------------	----------------	--------------

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金份额变动含人民币份额及美元现汇份额。

## § 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 (%)	

Haitong International Securities Company Limited	1	510,469,764.28	21.99	406,327.75	18.12	
China International Capital Corporation Limited	1	378,009,997.22	16.28	316,264.74	14.10	
UBS	1	306,984,955.26	13.22	306,984.92	13.69	
JPMORGAN	1	233,031,320.89	10.04	349,546.97	15.59	
Citigroup Global Markets Asia Limited	1	146,277,945.65	6.3	146,277.95	6.52	
CLSA	1	130,503,392.22	5.62	130,503.39	5.82	
国海证券股份有限公司	1	89,827,974.94	3.87	81,884.86	3.65	
开源证券股份有限公司	2	88,639,142.88	3.82	80,549.86	3.59	本期报告新增2个
天风证券股份有限公司	1	85,627,945.10	3.69	78,958.16	3.52	
太平洋证券股份有限公司	1	77,282,739.95	3.33	70,517.49	3.14	
第一创业证券股份有限公司	1	66,291,822.31	2.86	60,241.08	2.69	
Credit Suisse Hong Kong Limited	1	54,645,568.45	2.35	54,645.57	2.44	
中国国际金融股份有限公司	2	39,324,679.96	1.69	34,362.96	1.53	
中信建投证券股份有限公司	2	29,723,353.41	1.28	27,631.24	1.23	
Yuanta securities company limited	1	27,532,877.73	1.19	41,299.28	1.84	
华创证券有限责任公司	1	19,976,073.22	0.86	17,330.25	0.77	
MASTERLINK	1	18,833,271.03	0.81	22,599.70	1.01	
中信证券股份有限公司	3	18,283,199.72	0.79	16,835.35	0.75	
DBS Vickers (Hong Kong) Limited	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期报告新增 2个
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期报告新增 1个
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞信证券（中国）有限 公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中航证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中邮证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期报 告新增 1个
China Renaissance	1					
Goldman Sachs	1					
ICBC International Holdings Limited	1					

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；



- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

## 2) 选择程序

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

## 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS	-	-	-	-	-	-	-	-
JPMORGAN	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

太平洋证券股份有 限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Yuanta securities company limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MASTERLINK	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限 公司	-	-	-	-	139,774.84	100.00	-	-	-
长城证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限	-	-	-	-	-	-	-	-	-

公司								
恒泰证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞信证券（中国）有 限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
China Renaissance	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBC International Holdings Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	关于景顺长城大中华混合型证券投资基金 2023 年境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）和赎回业务安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 4 日
2	景顺长城大中华混合型证券投资基金	中国证监会指定报刊及	2023 年 1 月 16 日

	境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	网站	
3	景顺长城大中华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
4	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
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 10 日
6	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 23 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 24 日
8	关于旗下部分基金新增泰隆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 3 月 23 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 3 月 25 日
10	景顺长城大中华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
11	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
12	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 30 日
13	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 6 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 4 月 8 日
15	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
16	景顺长城大中华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
17	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
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 4 月 22 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2023 年 5 月 6 日

	停机维护的公告	网站	
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 13 日
21	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 23 日
22	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
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 5 月 27 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 10 日
25	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
26	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
27	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

## § 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	20230101-20230630	147,518,606.86	0.00	0.00	147,518,606.86	21.06
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</p>							

余投资者的赎回办理造成影响；

（3）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

（4）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

（5）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

（6）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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大中华股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城大中华混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城大中华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