

景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起  
式证券投资基金  
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：上海银行股份有限公司

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。

基金托管人上海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。

本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过 50%，本基金不向个人投资者公开销售。

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 .....	6
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 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
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 .....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
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>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	43
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 .....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	48

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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	50
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>55</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 .....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	景顺长城泰保三个月定开混合
基金主代码	010348
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 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	上海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,547,965,590.48 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、封闭期投资策略</p> <p>(1) 资产配置策略</p> <p>本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>(2) 股票投资策略</p> <p>本基金股票投资主要遵循“自下而上”的个股投资策略，利用我公司股票研究数据库（SRD）对企业进行深入细致的分析，并进一步挖掘出具有较强核心竞争优势的公司，最后以财务指标验证核心竞争优势分析的结果。</p> <p>(3) 债券投资策略</p> <p>债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>(4) 股指期货投资策略</p> <p>本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。</p> <p>(5) 国债期货投资策略</p> <p>本基金可投资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。</p> <p>(6) 股票期权投资策略</p> <p>本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p>(7) 资产支持证券投资策略</p>

	<p>本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×90% + 银行活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
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
客户服务电话	4008888606	95594
传真	0755-22381339	021-68476901
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 27 层
邮政编码	518048	200120
法定代表人	李进	金煜

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	-91,636,811.67
本期利润	-39,132,401.68
加权平均基金份额本期利润	-0.0154

本期加权平均净值利润率	-1.85%
本期基金份额净值增长率	-1.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-510,087,756.33
期末可供分配基金份额利润	-0.2002
期末基金资产净值	2,037,877,834.15
期末基金份额净值	0.7998
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	-20.02%

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。

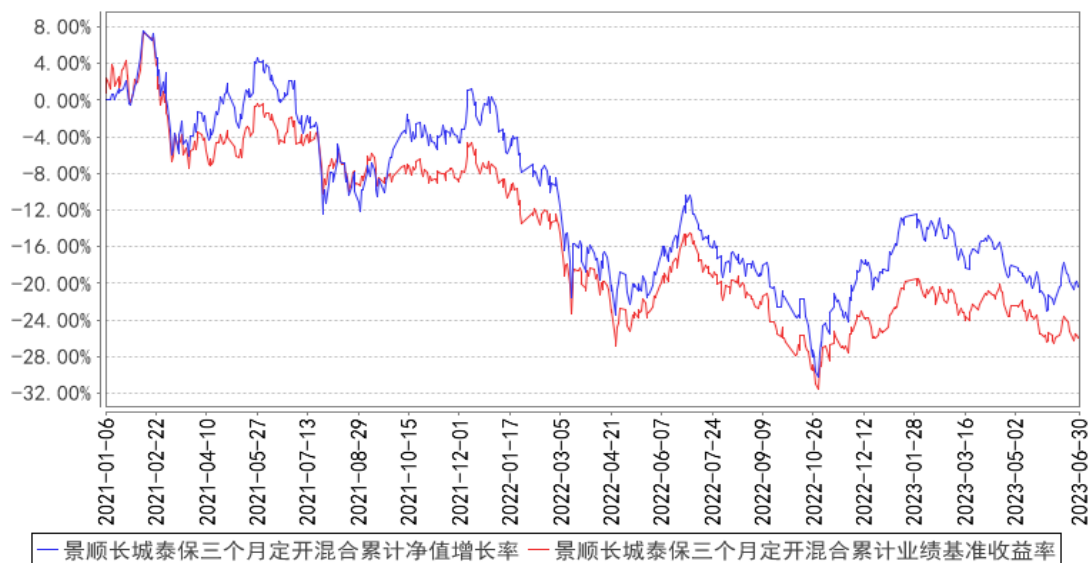
## 3.2 基金净值表现

### 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	3.88%	0.91%	1.05%	0.79%	2.83%	0.12%
过去三个月	-5.46%	0.79%	-4.62%	0.75%	-0.84%	0.04%
过去六个月	-1.88%	0.86%	-0.62%	0.76%	-1.26%	0.10%
过去一年	-10.73%	1.04%	-12.87%	0.89%	2.14%	0.15%
自基金合同生效起至今	-20.02%	1.21%	-25.66%	1.04%	5.64%	0.17%

### 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

景顺长城泰保三个月定开混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：封闭期内，本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%—100%；但在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但本基金封闭期内每个交易日日终，在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的建仓期为自 2021 年 1 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		
刘苏	本基金的基金经理	2021 年 1 月 6 日	-	18 年	理学硕士, CFA。曾任深圳国际信托投资有限公司（现华润深国投信托）信托业务部信托经理，鹏华基金基金管理部高级研究员、基金经理助理、基金经理。2015 年 5 月加入本公司，自 2015 年 9 月起担任股票投资部基金经理，并曾任研究部副总经理，现任研究部总经理、股票投资部基金经理。具有 18 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、《景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式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 上半年，春节前市场延续了 2022 年底的风格，受益于经济复苏的消费品、出行链表现较好，但春节后，低估值大盘股、央企蓝筹和 TMT 相关股票表现较为强劲，进入到二季度后，与 AI 人工智能相关的通信、传媒行业，和 AI 概念扩散涉及的机器人相关的机械设备零部件行业、汽车智能驾驶相关的领域，以及受益于煤价下跌的火电板块表现相对较好，涨幅较大，而与经济增长关联度较高的房地产、消费、化工、建材等板块普遍下跌。出现这种情况的原因，我们的理解是国内经济经过一季度的恢复性增长后，内生增长动力减弱，在缺乏政策强刺激的情况下，叠加工业企业去库存，呈现出宏观经济数据偏弱与微观企业经营压力加大的局面。与此同时，人民币相对美元的汇率也阶段性贬值，股票市场外资呈现净流出状态，经营业绩与宏观经济关联度较高的一些权重股走势低迷。在市场逐步认同人工智能将给人类社会带来巨大改变的情况下，资金相对追逐 AI 相关产业链主题，并逐渐扩散至机器人等相关主题。我们依然长期坚持投资高质量公司，强调投资标的的竞争力以及成长潜力，相对淡化短期景气，因此组合阶段性表现较为平淡。上半年基金管理人整体投资思路没有太多变化，依然坚持“买股票就是买企业”的思路，在可理解的“好生意、好公司”中，根据股价的波动，适当进行组合调整，不停优化组合的风险收益比。目前组合中，消费品和医疗服务占比相对较高，同时我们增加了一批基于自由现金流角度极度低估的周期类品种以及制造业细分市场中具备较强竞争优势的企业，比如部分资源股和前期表现平淡的电力设备品种，以及部分房地产产业链优质公司。我们希望真正能从实业投资的角度出发，持有一揽子资产回报率高且自由现金流创造能力强的优质企业，依靠企业的高质量经营来度过宏观确定性降低的时期。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 上半年，本基金份额净值增长率为-1.88%，业绩比较基准收益率为-0.62%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前市场对中长期宏观经济比较担忧，这里面有将短期问题长期化的情况，我们对国家未来的发展还是很有信心。短期中国经济确实处于转型期，从之前的中高速增长转向高质量发展，我们的理解是经济结构中高附加值产业的比重要持续提升。为了将社会资源更多投入到高附加值产业中，我们会牺牲一部分传统产业的发展空间，导致经济换挡过程中宏观增速放缓。这种产业升级是必要的，也是人均 GDP 持续提升的必要条件。但是在经济增速放缓的背景下如何投资，是摆在所有投资人面前的课题。从短期看，经济总有结构性的亮点，比如前两年的半导体、新能源，今年的人工智能相关的算力产业链，都呈现出较高的景气，也都成为资金阶段性追逐的目标。但从长期看，真正有护城河、有壁垒的产业和有竞争力的公司也会给投资人带来丰厚的回报，这也是我们一直追求的“好行业、好企业”。我们认为国家发展的最终目的是提高人均 GDP，提高老百姓的生活水平，因此消费升级会是持续的主题，而品牌与渠道实际上是非常深厚的护城河，这其中的投资机会依然值得挖掘。人口老龄化是显而易见的趋势，能够服务于这种趋势的企业如果构建起足够强的竞争壁垒，将是非常好的投资标的。

人工智能是今年以来市场最火热的话题，不少人认为这将是媲美电力、半导体、互联网这种级别的技术进步。纵观历史，当人类社会出现巨大技术进步并带来社会生产效率极大提升的情况出现时，这种技术进步的影响会持续几十年，直至变成社会的基础设施，无处不在。在此过程中，投资机会通常不是一蹴而就。对笃信价值投资的投资人而言，面对大的技术进步时，既要技术的进步保持敏感，也要遵循价值投资的基本原则：实业思维、能力圈、护城河、安全边际，我们需要尽力在变化的世界中找到不变量。人工智能技术如今仍在快速发展过程中，行业格局也仍有诸多不确定性，我们也在努力学习，希望能在三类机会中找到竞争力可维持的企业：第一类是有可能出现的未来占据人工智能“生态位”的企业，即人工智能相关的玩家都不得使用其产品的公司；第二类是具备“卖铲子”型的商业模式的企业，即为人工智能玩家提供具备独特差异化的辅助工具的公司，第三类是受益于人工智能技术进步能够降低运营成本或强化自身经营优势的公司。目前看到的具备先发竞争优势的公司大多集中在海外，针对我们可投资的市场，目前我们要做的就是持续的跟踪、学习。

过去几年，基金管理人始终坚持并不断完善“好行业、好企业、好时机”相结合的投资理念，我们希望找到那些商业模式优、行业壁垒深、投资赔率高、企业管理好的投资标的。简而言之，我们就是要找到基本盘稳定，且有增长潜力的公司。具体来说，我们平时的工作是从企业财务报

表作为出发点，重点研究那些资产回报率持续较高且自由现金流充沛的公司，然后再根据我们是否理解企业的业务、企业商业模式是否可预测、企业竞争优势是否可维持等条件进行判断，选出那些能够被我们定价的优质企业。最后根据我们对于企业的定价以及我们对回报率的要求，确定单个股票的买入、卖出点，从而进行操作：低于买点则买入，高于卖点则卖出，其它时间则等待。上次季报中，我们提到组合集中度的问题，在过去一个季度，尽管交易不多，但我们的持股集中度确实有所提升。同时，我们也储备了一批满足我们基本要求的“好行业、好企业”，在我们的理解中，投资就是不断比较，将资金配置在性价比最高的标的上。因此储备越多，我们的可选择范围越广，组合的性价比有可能得到更大的改善。希望市场波动能带给我们积极调整的机会。

最后强调一下我们的选股偏好：在具备较好赔率的前提下，我们聚焦于四类公司：第一类，产品或服务难被替代且有定价权的公司（好行业）；第二类，虽然业务存在替代品和竞争但已被证明存在显著竞争优势且竞争优势能够维持或持续加强的公司（好企业）；第三类，处于周期底部且估值预期较低的成本领先型公司（针对周期成长股的好时机）；第四类，是基于现金流角度的极度低估的机会，即站在自由现金流视角能以较短时间回本的投资机会（针对低估值低增速企业的好时机）。

#### 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

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

本基金为发起式基金，在本报告期内未触及《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

## § 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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，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，本基金的利润分配情况符合有关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，认为复核内容真实、准确、完整，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：景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金

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	上年度末
----	-----	-----	------

		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	187,100,178.03	190,779,029.67
结算备付金		383,749.47	629,014.70
存出保证金		456,167.55	324,474.65
交易性金融资产	6.4.7.2	1,844,042,440.32	1,887,578,435.94
其中：股票投资		1,844,042,440.32	1,880,431,582.76
基金投资		-	-
债券投资		-	7,146,853.18
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		8,099,703.82	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,040,082,239.19	2,079,310,954.96
<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		1,752.30	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,501,600.15	1,577,685.98
应付托管费		83,422.22	87,649.21
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		11.21	67.70
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	617,619.16	635,316.24

负债合计		2, 204, 405. 04	2, 300, 719. 13
<b>净资产：</b>			
实收基金	6. 4. 7. 10	2, 547, 965, 590. 48	2, 547, 965, 590. 48
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	-510, 087, 756. 33	-470, 955, 354. 65
净资产合计		2, 037, 877, 834. 15	2, 077, 010, 235. 83
负债和净资产总计		2, 040, 082, 239. 19	2, 079, 310, 954. 96

注： 报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.7998 元，基金份额总额 2,547,965,590.48 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金

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>		-29, 066, 771. 95	-265, 611, 155. 53
1. 利息收入		650, 436. 06	621, 563. 44
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	650, 436. 06	621, 563. 44
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-82, 221, 618. 00	-85, 325, 523. 81
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	-109, 157, 865. 25	-98, 626, 629. 15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 15	2, 232, 444. 89	101, 543. 66
资产支持证券投资	6. 4. 7. 16	-	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 17	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 18	-	-
股利收益	6. 4. 7. 19	24, 703, 802. 36	13, 199, 561. 68
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	52,504,409.99	-180,907,195.16
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>10,065,629.73</b>	<b>10,460,925.15</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,441,589.17	9,816,128.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	524,532.68	545,340.51
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		50.90	27.37
8. 其他费用	6.4.7.23	99,456.98	99,428.31
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-39,132,401.68</b>	<b>-276,072,080.68</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-39,132,401.68</b>	<b>-276,072,080.68</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>-39,132,401.68</b>	<b>-276,072,080.68</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金

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）	2,547,965,590.48	-	-470,955,354.65	2,077,010,235.83
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）	2,547,965,590.48	-	-470,955,354.65	2,077,010,235.83



三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-39,132,401.68	-39,132,401.68
(一)、综合收益总额	-	-	-39,132,401.68	-39,132,401.68
(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)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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)	2,547,965,590.48	-	-510,087,756.33	2,037,877,834.15
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)	2,547,965,590.48	-	10,940,154.46	2,558,905,744.94
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)	2,547,965,590.48	-	10,940,154.46	2,558,905,744.94
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-276,072,080.68	-276,072,080.68
(一)、综合收益总额	-	-	-276,072,080.68	-276,072,080.68

(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)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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)	2,547,965,590.48	-	-265,131,926.22	2,282,833,664.26

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

景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]2314 号文《关于准予景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2021 年 1 月 6 日生效。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,009,998,000.00 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 42,004.20 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,010,040,004.20 元，折合 1,010,040,004.20 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为上海银行股份有限

公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购方认购本基金的总额不少于人民币 1,000 万元，且发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

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交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括但不限于国债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（包括分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、公开发行的次级债）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括国债期货、股指期货、股票期权）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金的投资组合比例为：封闭期内，本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%—100%；但在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但本基金封闭期内每个交易日日终，在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金以定期开放的方式运作。本基金每三个月开放一次，第一个开放期的首日为基金合同生效日三个月以后的月度对日，第二个及以后的开放期首日为上一个开放期结束次日的三个月以后的月度对日。本基金每个开放期不少于 1 个工作日并且最长不超过 20 个工作日。本基金首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，亦不上市交易。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

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

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

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

##### (2) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开

放式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税; 国债、地方政府债券利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税; 存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定, 金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定, 本基金运营过程中发生的增值税应税行为, 以本基金的基金管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定, 证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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

### (3) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征企业所得税;

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

### (4) 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	187,100,178.03
等于：本金	187,064,027.37
加：应计利息	36,150.66
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	187,100,178.03

## 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	2,076,370,371.82	-	1,844,042,440.32	-232,327,931.50
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	2,076,370,371.82	-	1,844,042,440.32	-232,327,931.50

## 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

本基金本报告期末的买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	518,440.21
其中：交易所市场	518,440.21
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,178.95
合计	617,619.16

## 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	2,547,965,590.48	2,547,965,590.48
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,547,965,590.48	2,547,965,590.48

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	-194,763,921.16	-276,191,433.49	-470,955,354.65
本期利润	-91,636,811.67	52,504,409.99	-39,132,401.68
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-286,400,732.83	-223,687,023.50	-510,087,756.33

## 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	639,688.45
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	7,768.30
其他	2,979.31
合计	650,436.06

## 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	-109,157,865.25
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	-109,157,865.25

## 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	713,656,488.77
减：卖出股票成本总额	820,650,461.66

减：交易费用	2,163,892.36
买卖股票差价收入	-109,157,865.25

#### 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	14,156.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,218,288.01
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	2,232,444.89

##### 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	8,022,729.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,791,400.00
减：应计利息总额	12,719.78
减：交易费用	321.36
买卖债券差价收入	2,218,288.01

#### 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

无。

## 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	24,703,802.36
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	24,703,802.36

## 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	52,504,409.99
股票投资	53,848,774.17
债券投资	-1,344,364.18
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	52,504,409.99

## 6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

## 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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	266.03
其他	12.00
合计	99,456.98

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 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	9,441,589.17	9,816,128.96

其中：支付销售机构的客户维护费	-	-
-----------------	---	---

注：基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.90% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	524,532.68	545,340.51

注：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务交易。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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

基金合同生效日（2021 年 1 月 6 日）持有的基金份额	10,042,004.20	10,042,004.20
报告期初持有的基金份额	10,042,004.20	10,042,004.20
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,042,004.20	10,042,004.20
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3900%	0.3900%

#### 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
上海银行-活期	187,100,178.03	639,688.45	189,277,255.33	588,263.46

注：本基金的活期银行存款由基金托管人上海银行保管，并按银行间同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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	2023 年 3	6 个月	新股流通	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-

	能源	月 31 日		受限						
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	2023 年 6 月	6 个月	新股流通	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-

	科技	月 8 日		受限							
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	2023 年 6 月	6 个月	新股流通	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-	



	智能	月 1 日		受限							
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	131.11	53.24	261	34,219.71	13,895.64	-	
301322	绿通科技	2023 年 5 月 25 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	-	53.24	130	-	6,921.20	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	2,023	48,086.71	86,766.47	-	
301360	荣旗	2023 年 4 月	6 个月	新股流通	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-	

	科技	月 17 日		受限							
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	4,016	26,425.28	30,441.28	-	
601065	江盐	2023 年 3 月	6 个月	新股流通	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-	

	集团	月 31 日		受限							
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	-	
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-	
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-	
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-	
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	-	
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	-	
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	-	
688472	阿特	2023 年 6 月	6 个月	新股流通	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-	

	斯	月 2 日		受限							
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	-	
688485	九州一轨	2023 年 1 月 11 日	6 个月	新股 流通 受限	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-	
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	-	
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	-	
688623	双元科技	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	2023 年 6	6 个月	新股 流通	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-	

	科 技	月 16 日		受限					
--	--------	-----------	--	----	--	--	--	--	--

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易

所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券，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：0.34%）。

### 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的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
资产							
银行存款	187,100,178.03	-	-	-	-	-	187,100,178.03
结算备付金	383,749.47	-	-	-	-	-	383,749.47

存出保证金	456,167.55	-	-	-	-	-	456,167.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,844,042,440.32	1,844,042,440.32
应收证券清算款	-	-	-	-	-	8,099,703.82	8,099,703.82
资产总计	187,940,095.05	-	-	-	-	-1,852,142,144.14	2,040,082,239.19
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,501,600.15	1,501,600.15
应付托管费	-	-	-	-	-	83,422.22	83,422.22
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,752.30	1,752.30
应交税费	-	-	-	-	-	11.21	11.21
其他负债	-	-	-	-	-	617,619.16	617,619.16
负债总计	-	-	-	-	-	2,204,405.04	2,204,405.04
利率敏感度缺口	187,940,095.05	-	-	-	-	-	-
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	190,779,029.67	-	-	-	-	-	190,779,029.67
结算备付金	629,014.70	-	-	-	-	-	629,014.70
存出保证金	324,474.65	-	-	-	-	-	324,474.65
交易性金融资产	-	-	-2,886,113.23	4,260,739.95	1,880,431,582.76	-	1,887,578,435.94
资产总计	191,732,519.02	-	-2,886,113.23	4,260,739.95	1,880,431,582.76	-	2,079,310,954.96



计							
负债							
应付管理人报酬		-	-	-		1,577,685.98	1,577,685.98
应付托管费		-	-	-		87,649.21	87,649.21
应交税费		-	-	-		67.70	67.70
其他负债		-	-	-		635,316.24	635,316.24
负债总计		-	-	-		2,300,719.13	2,300,719.13
利率敏感度缺口	191,732,519.02	-	-2,886,113.23	4,260,739.95		-	-

#### 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 0.00%（上年度末：0.34%），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	1,844,042,440.32	90.49	1,880,431,582.76	90.54
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	1,844,042,440.32	90.49	1,880,431,582.76	90.54

#### 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%	86,112,484.75	109,216,920.38
	沪深 300 指数下降 5%	-86,112,484.75	-109,216,920.38

#### 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	1,842,263,289.39	1,885,572,336.32
第二层次	654,683.90	-
第三层次	1,124,467.03	2,006,099.62
合计	1,844,042,440.32	1,887,578,435.94

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,844,042,440.32	90.39
	其中：股票	1,844,042,440.32	90.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	187,483,927.50	9.19
8	其他各项资产	8,555,871.37	0.42
9	合计	2,040,082,239.19	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	30,560,090.00	1.50

B	采矿业	157,129,221.75	7.71
C	制造业	1,444,863,104.92	70.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	67,624,651.32	3.32
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	9,345,209.33	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,309,467.77	0.51
J	金融业	87,227,885.00	4.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,539,332.00	0.57
M	科学研究和技术服务业	25,285,814.92	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	62,048.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	85,098.56	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,844,042,440.32	90.49

### 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	000568	泸州老窖	579,133	121,368,902.81	5.96
2	600519	贵州茅台	71,705	121,253,155.00	5.95
3	000858	五粮液	711,086	116,312,337.02	5.71
4	300760	迈瑞医疗	351,957	105,516,708.60	5.18
5	300750	宁德时代	440,276	100,730,746.04	4.94
6	000333	美的集团	1,589,494	93,652,986.48	4.60
7	601899	紫金矿业	7,120,100	80,955,537.00	3.97
8	601088	中国神华	2,477,193	76,173,684.75	3.74
9	600690	海尔智家	3,210,341	75,378,806.68	3.70
10	603896	寿仙谷	1,688,379	74,795,189.70	3.67
11	600674	川投能源	4,490,977	67,589,203.85	3.32
12	603801	志邦家居	1,627,980	53,755,899.60	2.64
13	600989	宝丰能源	3,884,851	48,987,971.11	2.40
14	002311	海大集团	1,023,110	47,922,472.40	2.35
15	300059	东方财富	3,337,331	47,390,100.20	2.33

16	600887	伊利股份	1,643,234	46,536,386.88	2.28
17	603589	口子窖	921,400	45,471,090.00	2.23
18	600660	福耀玻璃	1,252,900	44,916,465.00	2.20
19	600298	安琪酵母	1,229,000	44,502,090.00	2.18
20	002318	久立特材	2,406,900	40,989,507.00	2.01
21	002142	宁波银行	1,574,616	39,837,784.80	1.95
22	603855	华荣股份	1,479,800	39,362,680.00	1.93
23	603596	伯特利	407,800	32,322,228.00	1.59
24	603899	晨光股份	704,548	31,451,022.72	1.54
25	300498	温氏股份	1,665,400	30,560,090.00	1.50
26	603100	川仪股份	731,259	28,416,724.74	1.39
27	300979	华利集团	569,800	27,772,052.00	1.36
28	603259	药明康德	405,209	25,248,572.79	1.24
29	000902	新洋丰	2,017,817	20,743,158.76	1.02
30	300294	博雅生物	469,089	17,018,548.92	0.84
31	600309	万华化学	189,400	16,636,896.00	0.82
32	601888	中国中免	104,400	11,539,332.00	0.57
33	300627	华测导航	336,000	10,909,920.00	0.54
34	603444	吉比特	20,514	10,074,630.54	0.49
35	600195	中牧股份	826,900	9,658,192.00	0.47
36	600546	山煤国际	642,700	9,299,869.00	0.46
37	000893	亚钾国际	379,400	8,703,436.00	0.43
38	601677	明泰铝业	566,207	7,858,953.16	0.39
39	002180	纳思达	228,600	7,829,550.00	0.38
40	300470	中密控股	24,300	1,123,146.00	0.06
41	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
42	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
43	002475	立讯精密	7,311	237,241.95	0.01
44	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.01
45	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.01
46	300630	普利制药	7,588	148,345.40	0.01
47	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
48	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.01
49	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
50	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.01
51	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.00
52	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.00
53	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.00
54	301323	新莱福	2,277	97,593.33	0.00
55	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
56	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
57	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.00
58	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00

59	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
60	301165	锐捷网络	1,077	66,472.44	0.00
61	301267	华夏眼科	1,006	61,315.70	0.00
62	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.00
63	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
64	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
65	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
66	301367	怡和嘉业	223	33,079.82	0.00
67	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
68	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
69	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
70	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
71	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
72	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
73	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
74	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
75	301322	绿通科技	391	20,816.84	0.00
76	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
77	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
78	301377	鼎泰高科	770	17,710.00	0.00
79	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
80	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
81	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
82	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
83	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
84	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
85	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
86	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
87	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
88	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
89	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
90	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
91	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
92	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
93	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
94	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
95	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
96	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
97	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
98	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
99	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
100	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
101	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00

102	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
103	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
104	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
105	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
106	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
107	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
108	001367	海森药业	55	2,171.40	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	300750	宁德时代	97,470,121.94	4.69
2	601088	中国神华	60,192,797.76	2.90
3	603801	志邦家居	55,855,765.00	2.69
4	603589	口子窖	53,836,457.67	2.59
5	601899	紫金矿业	42,922,440.00	2.07
6	002318	久立特材	39,858,255.00	1.92
7	603855	华荣股份	33,390,904.90	1.61
8	603596	伯特利	30,980,915.35	1.49
9	603100	川仪股份	27,953,748.48	1.35
10	300498	温氏股份	27,455,608.26	1.32
11	300760	迈瑞医疗	26,113,338.00	1.26
12	600690	海尔智家	24,498,745.41	1.18
13	002180	纳思达	22,568,042.35	1.09
14	603444	吉比特	21,733,445.90	1.05
15	002142	宁波银行	20,558,013.64	0.99
16	000333	美的集团	16,814,668.77	0.81
17	300979	华利集团	16,733,688.75	0.81
18	300627	华测导航	11,804,453.00	0.57
19	601677	明泰铝业	11,091,204.78	0.53
20	000893	亚钾国际	11,016,520.00	0.53

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603444	吉比特	85,736,535.83	4.13
2	002463	沪电股份	70,920,724.88	3.41
3	002475	立讯精密	70,429,879.00	3.39
4	601688	华泰证券	64,902,977.68	3.12
5	600048	保利发展	54,565,254.20	2.63

6	002142	宁波银行	49,974,370.60	2.41
7	002415	海康威视	39,999,861.00	1.93
8	300630	普利制药	37,963,787.00	1.83
9	603882	金域医学	32,482,973.79	1.56
10	300699	光威复材	29,458,312.00	1.42
11	603899	晨光股份	29,438,763.52	1.42
12	601888	中国中免	27,620,779.32	1.33
13	603259	药明康德	22,825,994.45	1.10
14	300979	华利集团	12,919,568.43	0.62
15	002027	分众传媒	12,709,197.20	0.61
16	002709	天赐材料	12,381,911.27	0.60
17	603833	欧派家居	8,775,257.00	0.42
18	603197	保隆科技	8,562,458.72	0.41
19	002180	纳思达	8,156,630.04	0.39
20	600989	宝丰能源	6,107,808.00	0.29

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	730,412,545.05
卖出股票收入（成交）总额	713,656,488.77

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

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

本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

1) 时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。



2) 套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

3) 合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

## 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	456,167.55
2	应收清算款	8,099,703.82
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,555,871.37

### 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 (%)
6	424,660,931.75	2,547,965,590.48	100.00	0.00	0.00

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

## 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。

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例(%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资 金	10,042,004.20	0.39	10,000,000.00	0.99	3年
基金管理人高级管 理人员	-	-	-	-	不适用
基金经理等人员	-	-	-	-	不适用
基金管理人股东	-	-	-	-	不适用
其他	-	-	-	-	不适用
合计	10,042,004.20	0.39	10,000,000.00	0.99	-

注：发起份额总数为不包含利息的认购份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 1 月 6 日）基金份额总额	1, 010, 040, 004. 20
本报告期期初基金份额总额	2, 547, 965, 590. 48
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2, 547, 965, 590. 48

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：

2023 年 3 月，项寅同志担任上海银行股份有限公司资产托管部副总经理职务，上述人事变动已进行备案、公告。

### 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 (%)	
国泰君安证券股份有限公司	2	537,792,668.85	37.53	500,849.04	37.53	-
兴业证券股份有限公司	2	248,232,762.43	17.32	231,176.08	17.32	-
华泰证券股份有限公司	2	244,517,562.01	17.06	227,717.54	17.06	-
中信证券股份有限公司	2	201,782,657.23	14.08	187,921.32	14.08	-
申万宏源证券有限公司	2	200,577,477.17	14.00	186,796.73	14.00	-
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	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的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	323,387.25	4.03	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	7,699,341.90	95.97	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

## 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	景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金 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
2	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
3	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 10 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 24 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 25 日
6	景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
8	景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金关于 2023 年 3 月 31 日至 2023 年 4 月 28 日第七个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 29 日
9	景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金关于 2023 年 3 月 31 日至 2023 年 4 月 28 日第七个开放期开放申购、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
10	景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金关于 2023 年 3 月 31 日至 2023 年 4 月 28 日第七个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 31 日
11	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
12	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
13	景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金 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
14	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
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 4 月 22 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 6 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 13 日
18	景顺长城泰保三个月定期开放混合型	中国证监会指定报刊及	2023 年 5 月 26 日

	发起式证券投资基金 2023 年第 1 号更新招募说明书	网站	
19	景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式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	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
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 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	2,537,923,586.28	0.00	0.00	2,537,923,586.28	99.61

#### 产品特有风险

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

#### 1、大额申购风险

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

#### 2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(1) 基金在短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；

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

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

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

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

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

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文

件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

### 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泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式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