

景顺长城致远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 2 月 28 日（基金合同生效日）起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|-----------------------------------------------|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 3.3 其他指标 | 9 |
| § 4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 管理人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 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 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真实、准确和完整发表意见 | 13 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 42 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 42 |
| 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 | 45 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 47 |

| | |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 47 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 47 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 48 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 48 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 48 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 49 |
| 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 | 49 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 49 |
| § 10 重大事件揭示 | 50 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 50 |
| 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 | 50 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 50 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 50 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 50 |
| 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 | 50 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 50 |
| 10.8 其他重大事件 | 55 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 57 |
| 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 | 57 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 57 |
| § 12 备查文件目录 | 57 |
| 12.1 备查文件目录 | 57 |
| 12.2 存放地点 | 58 |
| 12.3 查阅方式 | 58 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------|-----------------|
| 基金名称 | 景顺长城致远混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 景顺长城致远混合 | |
| 基金主代码 | 017860 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2023 年 2 月 28 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 | 1,241,342,515.24 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 景顺长城致远混合 A | 景顺长城致远混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 017860 | 017861 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,189,036,976.67 份 | 52,305,538.57 份 |

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和中长期资本增值。 |
| 投资策略 | <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>本基金通过定性与定量相结合的积极投资策略，精选资产回报率高且兼具成长性的公司的股票构建投资组合。</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、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>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金参与股指期货交易，将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>6、国债期货投资策略</p> <p>本基金可投资国债期货，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。</p> |

| | |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | <p>7、股票期权投资策略 本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。</p> <p>8、参与融资业务的投资策略 本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。</p> <p>9、信用衍生品投资策略 本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*75%+中证综合债指数收益率*20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5% |
| 风险收益特征 | <p>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。</p> <p>本基金还可能投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> |

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 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | | 518048 | 100140 |
| 法定代表人 | | 李进 | 陈四清 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 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 | 2023 年 2 月 28 日（基金合同生效日）-2023 年 6 月 30 日 | |
|---------------|------------------------------------------|---------------|
| | 景顺长城致远混合 A | 景顺长城致远混合 C |
| 本期已实现收益 | 8,297,668.45 | 271,809.09 |
| 本期利润 | -89,126,263.97 | -4,285,039.02 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0732 | -0.0767 |
| 本期加权平均净值利润率 | -7.62% | -7.99% |
| 本期基金份额净值增长率 | -7.23% | -7.42% |
| 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 | -85,919,718.40 | -3,876,944.24 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0723 | -0.0741 |
| 期末基金资产净值 | 1,103,117,258.27 | 48,428,594.33 |
| 期末基金份额净值 | 0.9277 | 0.9258 |
| 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 | -7.23% | -7.42% |

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

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

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

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

5、本基金基金合同生效日为 2023 年 2 月 28 日。

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

景顺长城致远混合 A

| 阶段 | 份额净 | 份额净值 | 业绩比较基 | 业绩比较基准 | ①-③ | ②-④ |
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|

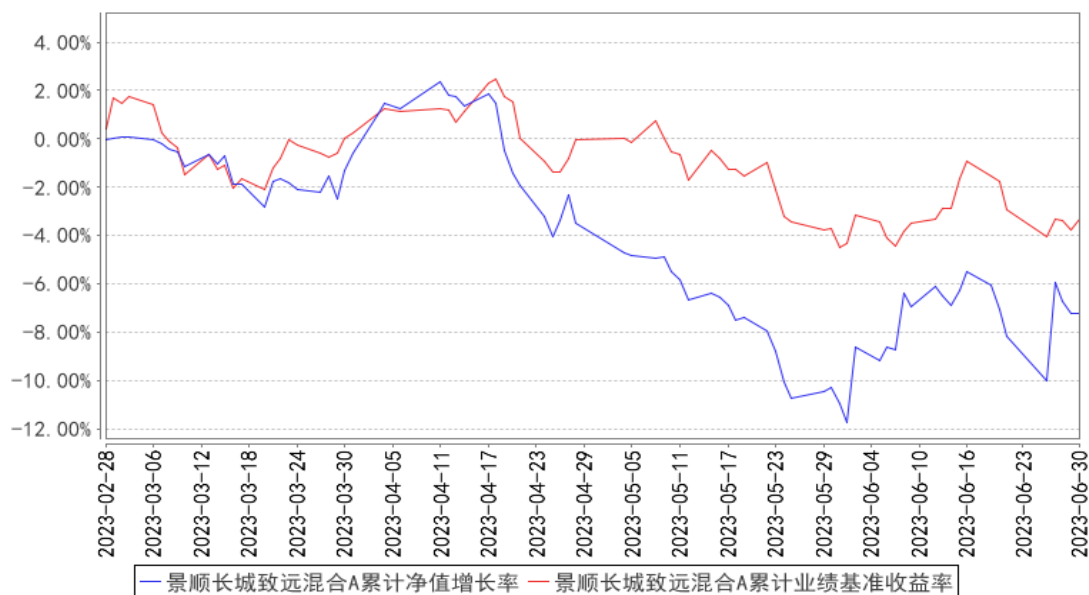
| | 值增长率① | 增长率标准差② | 准收益率③ | 收益率标准差④ | | |
|------------|--------|---------|--------|---------|--------|-------|
| 过去一个月 | 4.18% | 1.62% | 1.24% | 0.69% | 2.94% | 0.93% |
| 过去三个月 | -6.68% | 1.16% | -3.57% | 0.67% | -3.11% | 0.49% |
| 自基金合同生效起至今 | -7.23% | 1.02% | -3.32% | 0.66% | -3.91% | 0.36% |

景顺长城致远混合 C

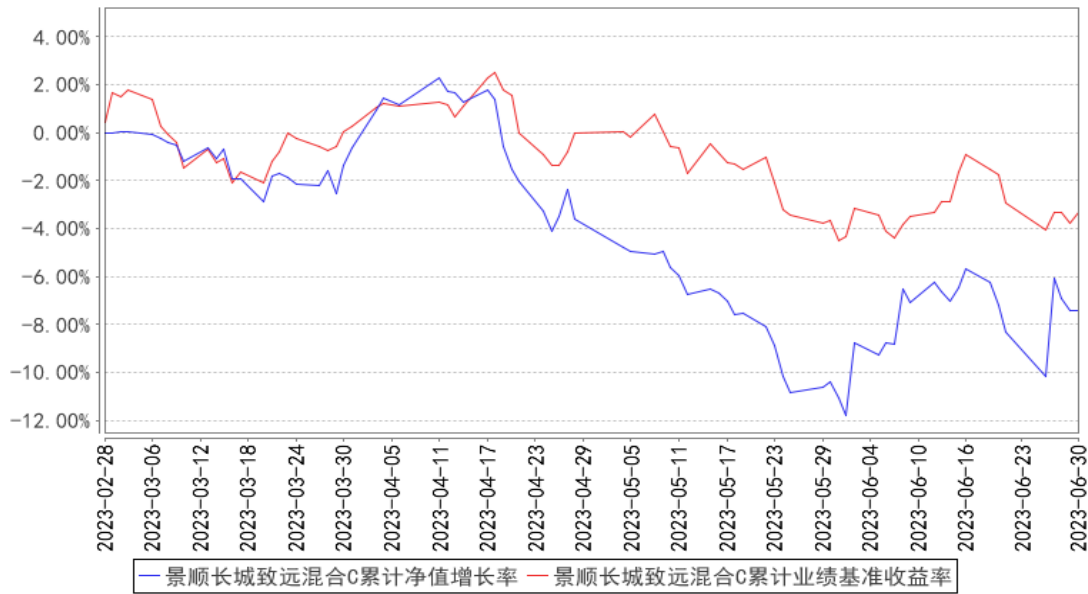
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 4.13% | 1.62% | 1.24% | 0.69% | 2.89% | 0.93% |
| 过去三个月 | -6.82% | 1.15% | -3.57% | 0.67% | -3.25% | 0.48% |
| 自基金合同生效起至今 | -7.42% | 1.02% | -3.32% | 0.66% | -4.10% | 0.36% |

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

景顺长城致远混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城致远混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，本基金投资港股通标的股票的比例占基金股票资产的比例为 0%-50%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2023 年 2 月 28 日基金合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2023 年 2 月 28 日）起至本报告期末不满一年。

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 | | |
| 韩文强 | 本基金的基金经理 | 2023年2月28日 | - | 14年 | 管理学博士。曾任中国人寿资产管理有限公司基金投资部研究员、投资经理。2019年8月加入本公司，自2019年10月起担任股票投资部基金经理，现任股票投资部总监、基金经理。具有14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、《景顺长城致远混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少

的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 17 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年海内外的经济，海外方面，今年上半年，美国经济的韧性超出市场预期。虽然欧美在高通胀及货币政策快速紧缩的压力下隐现衰退风险，且以欧美银行业为代表的部分风险点也已有所暴露，但美国经济在服务业的支撑下，就业、消费等数据持续超出市场预期，在很大程度上抵补了货币紧缩的压力，呈现出相当的韧性。国内方面，一季度经济在疫情压制需求集中释放下修复明显，随着补偿性需求释放完全，二季度基本面略有回落，居民部门持续去杠杆，社融增速大幅回落，消费、地产销售数据不及预期，工业企业盈利承压，企业持续主动去库，生产走弱。

上半年，本基金保持了较高的仓位，出于对经济底部的判断，虽然我们也认为底部的形态很难是 V 型，持续时间也可能较长，但经济启动的时点和催化剂往往都是事后才能清晰可见，对投资来说更确定的是坚信经济复苏一定回来，经济不可能持续的弱，无论是经济的周期性还是整个社会对经济持续弱的忍耐力都是有底限的，而股票市场通常会领先最终的经济复苏，且过去的经验看 90%的涨幅在 10%的交易日，也就是说大部分的时间都是等待，而这种等待的意义在于这是模糊的正确，一定要看到明确的经济复苏，往往会犯精确的错误，错过最有弹性的行情。基于这样的判断，我们的组合结构主要在一线改善房地产开放商、功能性具备更新需求的建材龙头、造船龙头、体检龙头、中药、具备成本优势且有一定成长性的生猪龙头。前两个行业主要是下注经济复苏，后面的行业均是自身的行业周期进入拐点且与经济相关性不大，这样可以适当对冲组合的风险。我们没有为了分散去分散，配置一堆跟经济相关的行业，看似分散实则是一个大贝塔。选择的与经济复苏相关的行业均是经济复苏前段的行业，一些经济复苏后段才受益的行业，我们会在经济复苏相对明确后逐渐置换，比如计算机等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年 2 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日，景顺长城致远混合 A 类份额净值增长率为-7.23%，业绩比较基准收益率为-3.32%。

2023 年 2 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日，景顺长城致远混合 C 类份额净值增长率为-7.42%，业绩比较基准收益率为-3.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，从海外来看，随着货币紧缩的维持，以及信贷条件进一步收紧，依然制约美国

经济基本面的修复空间。不过因为美国积累的较高的超额储蓄尚未释放完全，以及服务业尚有一定修复空间，就业依然保持韧性，经济失速的风险不大。货币政策方面，美联储货币政策从“急加息”转为“观望期”。美联储自 2022 年 3 月开启史上最快加息周期以来，加息速度先升后落（25→50→75→50→25），6 月会议跳过加息，但是上调点阵图，传递下半年“每两次会议加 25BP”信号，显示美联储处于政策观察期。国内方面，“稳增长”政策有望加快落地，或可阶段性支撑基建、地产，但居民部门去杠杆的长期行为较难扭转。地方政府方面，今年土地市场仍然萎靡，政府性基金收入持续负增长，城投企业债务压力较大，此外持续多年高基建后也缺乏足够的能产生稳定收益的优质项目。出口方面，虽然美国商品终端销售具有一定韧性，但是美国贸易商尚处于主动去库存阶段，叠加收紧的金融环境压制基本面的上行空间，预计短期内我国出口将继续承压。资金方面，5 月以来 DR007 周均值处于政策利率下方，6 月 13 日逆回购利率调降 10bp 至 1.9%，随后 1 年 MLF 利率和 LPR 利率同样下调。我们认为当前经济压力较大，尚需货币政策的呵护，下半年货币政策预期维持宽松，预期流动性保持合理充裕。经济周期从冷到热，往复循环。经历了 3 年疫情，包括房地产行业的衰退，经济已处于历史相对低位，后续稳增长政策大概率会陆续出台，相信经济将会再次复苏，只是现在经济体量太大，回升启动的速率会比过去的经济底部来得慢，需要耐心。

总之，我们相信随着经济的复苏，市场能再次进入类似于 2016、2017 年的行情。

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其适用性的情况时，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

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：景顺长城致远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 |
|---------------|------------|--------------------------------|
| 资产: | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 74,455,516.92 |
| 结算备付金 | | 418,274.09 |
| 存出保证金 | | 279,016.54 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,067,967,303.87 |
| 其中: 股票投资 | | 1,067,967,303.87 |
| 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 | | 7,405,594.77 |
| 应收股利 | | 4,934,342.43 |
| 应收申购款 | | 17,051.55 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - |
| 资产总计 | | 1,155,477,100.17 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
| 负债: | | |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | 1,567,904.41 |
| 应付管理人报酬 | | 1,424,584.04 |
| 应付托管费 | | 237,430.68 |
| 应付销售服务费 | | 24,385.46 |
| 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 | 676,942.98 |
| 负债合计 | | 3,931,247.57 |
| 净资产： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 1,241,342,515.24 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | -89,796,662.64 |
| 净资产合计 | | 1,151,545,852.60 |
| 负债和净资产总计 | | 1,155,477,100.17 |

注：1. 报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,241,342,515.24 份，其中 A 类基金份额净值 0.9277 元，基金份额 1,189,036,976.67 份；C 类基金份额净值 0.9258 元，基金份额 52,305,538.57 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2023 年 2 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城致远混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 2 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 |
|---------------------------|----------|----------------------------------------------|
| | | 2023 年 2 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
| 一、营业总收入 | | -86,059,699.06 |
| 1. 利息收入 | | 350,530.91 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 350,530.91 |
| 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） | | 15,473,471.31 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | 4,544,906.13 |
| 基金投资收益 | | -165,681.53 |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.16 | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | 848,416.03 |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 10,245,830.68 |
| 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“-” | 6.4.7.20 | -101,980,780.53 |

| | | |
|-----------------------------|----------------|--------------------------|
| 号填列) | | |
| 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 | 97, 079. 25 |
| 减: 二、营业总支出 | | 7, 351, 603. 93 |
| 1. 管理人报酬 | 6. 4. 10. 2. 1 | 6, 134, 733. 80 |
| 2. 托管费 | 6. 4. 10. 2. 2 | 1, 022, 455. 60 |
| 3. 销售服务费 | 6. 4. 10. 2. 3 | 107, 525. 95 |
| 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 | | 3, 060. 77 |
| 8. 其他费用 | 6. 4. 7. 23 | 83, 827. 81 |
| 三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列) | | -93, 411, 302. 99 |
| 减: 所得税费用 | | - |
| 四、净利润 (净亏损以“-”号填列) | | -93, 411, 302. 99 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | -93, 411, 302. 99 |

6.3 净资产 (基金净值) 变动表

会计主体: 景顺长城致远混合型证券投资基金

本报告期: 2023 年 2 月 28 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 2 月 28 日 (基金合同生效日) 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) | - | - | - | - |
| 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) | 1, 281, 594, 947. 41 | - | - | 1, 281, 594, 947. 41 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | -40, 252, 432. 17 | - | -89, 796, 662. 64 | -130, 049, 094. 81 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -93, 411, 302. 99 | -93, 411, 302. 99 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -40, 252, 432. 17 | - | 3, 614, 640. 35 | -36, 637, 791. 82 |

| | | | | |
|------------------------------------------|------------------|---|----------------|------------------|
| (净值减少以“-”号填列) | | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,083,797.31 | - | -169,751.27 | 1,914,046.04 |
| 2. 基金赎回款 | -42,336,229.48 | - | 3,784,391.62 | -38,551,837.86 |
| (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) | 1,241,342,515.24 | - | -89,796,662.64 | 1,151,545,852.60 |

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

景顺长城致远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[2023]203号《关于准予景顺长城致远混合型证券投资基金注册的批复》注册,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《景顺长城致远混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,281,052,731.77元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第0107号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城致远混合型证券投资基金基金合同》于2023年2月28日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为1,281,594,947.41份基金份额,其中认购资金利息折合542,215.64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。

根据《景顺长城致远混合型证券投资基金基金合同》和《景顺长城致远混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用,但不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的,称为A类基金份额;从本类别基金资产净值中计提销售服务费,但不收取认购/申购费用

的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自行选择认购/申购基金份额的类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城致远混合型证券投资基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券)、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、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金可以根据法律法规的规定参与融资业务。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，本基金投资于港股通标的股票的比例占基金股票资产的比例为 0%-50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*75%+中证综合债指数收益率*20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2023 年 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 2 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止期间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 2 月 28 日(基金合同生效日)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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2023 年 2 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中基协字[2022]566号《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益

品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

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

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收

入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------------|------------------------|
| 活期存款 | 74,455,516.92 |
| 等于：本金 | 74,448,664.85 |
| 加：应计利息 | 6,852.07 |
| 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 | 74,455,516.92 |

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 | 1,169,948,084.40 | - | 1,067,967,303.87 | -101,980,780.53 |
| 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 | 1,169,948,084.40 | - | 1,067,967,303.87 | -101,980,780.53 |

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 | 1,300.71 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 595,017.57 |
| 其中：交易所市场 | 595,017.57 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 80,624.70 |
| 合计 | 676,942.98 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城致远混合 A

| 项目 | 本期 2023年2月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日 | |
|---------------|--------------------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 1,224,955,551.33 | 1,224,955,551.33 |
| 本期申购 | 868,016.40 | 868,016.40 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -36,786,591.06 | -36,786,591.06 |
| 本期末 | 1,189,036,976.67 | 1,189,036,976.67 |

景顺长城致远混合 C

| 项目 | 本期 2023 年 2 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 | |
|---------------|-------------------------------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 56,639,396.08 | 56,639,396.08 |
| 本期申购 | 1,215,780.91 | 1,215,780.91 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -5,549,638.42 | -5,549,638.42 |
| 本期末 | 52,305,538.57 | 52,305,538.57 |

注：1. 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。。

2. 本基金合同于 2023 年 2 月 28 日生效。首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 1,281,052,731.77 元，折合 1,281,052,731.77 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 542,215.64 元，折合 542,215.64 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 1,281,594,947.41 元，折合 1,281,594,947.41 份基金份额。

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

景顺长城致远混合 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|--------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 8,297,668.45 | -97,423,932.42 | -89,126,263.97 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -172,985.65 | 3,379,531.22 | 3,206,545.57 |
| 其中：基金申购款 | 3,979.37 | -69,273.14 | -65,293.77 |
| 基金赎回款 | -176,965.02 | 3,448,804.36 | 3,271,839.34 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 8,124,682.80 | -94,044,401.20 | -85,919,718.40 |

景顺长城致远混合 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 271,809.09 | -4,556,848.11 | -4,285,039.02 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -15,595.15 | 423,689.93 | 408,094.78 |
| 其中：基金申购款 | 3,968.77 | -108,426.27 | -104,457.50 |
| 基金赎回款 | -19,563.92 | 532,116.20 | 512,552.28 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 256,213.94 | -4,133,158.18 | -3,876,944.24 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|--------------------------------|
| | 2023年2月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 334,735.19 |
| 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 | 14,754.63 |
| 其他 | 1,041.09 |
| 合计 | 350,530.91 |

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2月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 4,544,906.13 |
| 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 | 4,544,906.13 |

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2月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 342,632,967.77 |
| 减：卖出股票成本总额 | 335,671,011.52 |
| 减：交易费用 | 2,417,050.12 |
| 买卖股票差价收入 | 4,544,906.13 |

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------------------|--------------------------------|
| | 2023年2月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
| 卖出权证成交总额 | 875,719.18 |
| 减：卖出权证成本总额 | - |
| 减：交易费用 | 1,796.77 |
| 减：买卖权证差价收入应缴纳增值 税额 | 25,506.38 |
| 买卖权证差价收入 | 848,416.03 |

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2月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 10,245,830.68 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 10,245,830.68 |

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2月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | -101,980,780.53 |
| 股票投资 | -101,980,780.53 |
| 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 | -101,980,780.53 |

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|--------------------------------|
| | 2023年2月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 96,700.51 |
| 基金转换费收入 | 378.74 |
| 合计 | 97,079.25 |

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2月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
| 审计费用 | 32,052.57 |
| 信息披露费 | 44,072.13 |
| 证券出借违约金 | - |
| 债券托管账户维护费 | 4,500.00 |
| 银行划款手续费 | 219.00 |
| 其他 | 400.00 |
| 证券组合费 | 2,584.11 |
| 合计 | 83,827.81 |

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 |

| | |
|--------------------|-----------------|
| 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 |
| 大连实德集团有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 景顺资产管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 开滦(集团)有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 景顺长城资产管理(深圳)有限公司 | 基金管理人的子公司 |

注：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2月28日(基金合同生效日)至2023年6月30日 | |
|-------|--------------------------------------|-----------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) |
| 长城证券 | 68,961,063.41 | 3.75 |

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2月28日(基金合同生效日)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 | 64,223.75 | 3.80 | 22,451.70 | 3.77 |

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2月28日(基金合同生效日)至2023年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,026,160.97 |

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X1.50%/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 2 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,022,455.60 |

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

日托管费=前一日基金资产净值 X0.25%/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 2 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 景顺长城致远混合 A | 景顺长城致远混合 C | 合计 |
| 景顺长城基金管理有限公司 | - | 303.37 | 303.37 |
| 中国工商银行 | - | 41,982.76 | 41,982.76 |
| 长城证券 | - | - | - |
| 合计 | - | 42,286.13 | 42,286.13 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.60%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。

其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X0.60%/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

本基金本报告期末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

本基金于本报告期末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

本基金于本报告期末未发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期末未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

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2月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日 | |
|-----------|--------------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行-活期 | 74,455,516.92 | 334,735.19 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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

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 |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 301232 | 飞沃科技 | 2023年6月8日 | 6个月 | 新股流通受限 | 72.50 | 58.42 | 165 | 11,962.50 | 9,639.30 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 301320 | 豪江智能 | 2023年6月1日 | 6个月 | 新股流通受限 | 13.06 | 20.62 | 642 | 8,384.52 | 13,238.04 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 301360 | 荣旗科技 | 2023年4月17日 | 6个月 | 新股流通受限 | 71.88 | 92.60 | 134 | 9,631.92 | 12,408.40 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 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 | 6个月 | 新股流 | 14.16 | 16.21 | 888 | 12,574.08 | 14,394.48 | - |

| | | 月 9 日 | | 通受限 | | | | | | |
|--------|------|-----------------|-----------|--------|--------|--------|--------|-----------|-----------|---|
| 688352 | 硕中科技 | 2023 年 4 月 11 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 12.10 | 12.07 | 2,361 | 28,568.10 | 28,497.27 | - |
| 688361 | 中科飞测 | 2023 年 5 月 12 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 23.60 | 64.67 | 831 | 19,611.60 | 53,740.77 | - |
| 688429 | 时创能源 | 2023 年 6 月 20 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 19.20 | 25.53 | 346 | 6,643.20 | 8,833.38 | - |
| 688433 | 华曙高科 | 2023 年 4 月 7 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 26.66 | 31.50 | 418 | 11,143.88 | 13,167.00 | - |
| 688443 | 智翔金泰 | 2023 年 6 月 13 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 37.88 | 29.49 | 2,453 | 92,919.64 | 72,338.97 | - |
| 688458 | 美芯晟 | 2023 年 5 月 15 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 75.00 | 90.76 | 221 | 16,575.00 | 20,057.96 | - |
| 688469 | 中芯集成 | 2023 年 4 月 28 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 5.69 | 5.41 | 13,800 | 78,522.00 | 74,658.00 | - |
| 688472 | 阿特斯 | 2023 年 6 月 2 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 11.10 | 17.04 | 5,120 | 56,832.00 | 87,244.80 | - |
| 688478 | 晶升股份 | 2023 年 4 月 13 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 32.52 | 42.37 | 402 | 13,073.04 | 17,032.74 | - |
| 688479 | 友车科技 | 2023 年 5 月 4 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 33.99 | 29.49 | 332 | 11,284.68 | 9,790.68 | - |
| 688543 | 国科军工 | 2023 年 6 月 14 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 43.67 | 53.05 | 410 | 17,904.70 | 21,750.50 | - |
| 688562 | 航天软件 | 2023 年 5 月 15 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 12.68 | 22.31 | 726 | 9,205.68 | 16,197.06 | - |
| 688576 | 西山科技 | 2023 年 5 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 135.80 | 120.41 | 240 | 32,592.00 | 28,898.40 | - |
| 688582 | 芯动联科 | 2023 年 6 月 21 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 26.74 | 40.68 | 648 | 17,327.52 | 26,360.64 | - |
| 688593 | 新相微 | 2023 年 5 月 25 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 11.18 | 14.59 | 959 | 10,721.62 | 13,991.81 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023 年 6 月 30 日 | 1 个月内 (含) | 新股流通受限 | 55.00 | 55.00 | 1,251 | 68,805.00 | 68,805.00 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023 年 6 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 55.00 | 55.00 | 140 | 7,700.00 | 7,700.00 | - |
| 688620 | 安凯微 | 2023 年 6 月 15 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 10.68 | 12.34 | 1,016 | 10,850.88 | 12,537.44 | - |
| 688623 | 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 | 华丰科技 | 2023 年 6 月 16 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 9.26 | 18.59 | 708 | 6,556.08 | 13,161.72 | - |
| 688631 | 莱斯信息 | 2023 年 6 月 19 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 25.28 | 29.87 | 336 | 8,494.08 | 10,036.32 | - |

6.4.12.2 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约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

于本报告期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券。

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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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

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

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 | 74,455,516.92 | - | - | - | - | - | 74,455,516.92 |
| 结算备付金 | 418,274.09 | - | - | - | - | - | 418,274.09 |
| 存出保证金 | 279,016.54 | - | - | - | - | - | 279,016.54 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 1,067,967,303.87 | 1,067,967,303.87 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 4,934,342.43 | 4,934,342.43 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 17,051.55 | 17,051.55 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 7,405,594.77 | 7,405,594.77 |
| 资产总计 | 75,152,807.55 | - | - | - | - | 1,080,324,292.62 | 1,155,477,100.17 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 1,567,904.41 | 1,567,904.41 |

| | | | | | | |
|---------|---------------|---|---|---|--------------|--------------|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 1,424,584.04 | 1,424,584.04 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 237,430.68 | 237,430.68 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 24,385.46 | 24,385.46 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 676,942.98 | 676,942.98 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 3,931,247.57 | 3,931,247.57 |
| 利率敏感度缺口 | 75,152,807.55 | - | - | - | - | - |

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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 136,991,448.67 | - | 136,991,448.67 |
| 资产合计 | - | 136,991,448.67 | - | 136,991,448.67 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 136,991,448.67 | - | 136,991,448.67 |

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） |
| | 所有外币相对人民币升值5% | 6,849,572.43 |
| | 所有外币相对人民币贬值5% | -6,849,572.43 |

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 | |
|---------------|-------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 1,067,967,303.87 | 92.74 |
| 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 | 1,067,967,303.87 | 92.74 |

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） |
| | 沪深 300 指数上升 5% | 61,694,828.78 |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -61,694,828.78 |

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 |
|---------------|-------------------|
| 第一层次 | 1,066,400,965.74 |
| 第二层次 | 622,660.86 |
| 第三层次 | 943,677.27 |
| 合计 | 1,067,967,303.87 |

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。

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 | 1,067,967,303.87 | 92.43 |
| | 其中：股票 | 1,067,967,303.87 | 92.43 |
| 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 | 74,873,791.01 | 6.48 |
| 8 | 其他各项资产 | 12,636,005.29 | 1.09 |
| 9 | 合计 | 1,155,477,100.17 | 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 136,991,448.67 元，占基金资产净值的比例为 11.90%。

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 | 147,020,343.10 | 12.77 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 515,185,147.83 | 44.74 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 2,375.51 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 7,304,245.00 | 0.63 |
| 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 | 61,630.42 | 0.01 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 159,117,159.00 | 13.82 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 14,394.48 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 102,270,559.86 | 8.88 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 930,975,855.20 | 80.85 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|------|-----------|--------------|
|------|-----------|--------------|

| | | |
|---------|----------------|-------|
| 原材料 | - | - |
| 周期性消费品 | - | - |
| 非周期性消费品 | - | - |
| 综合 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 金融 | 136,470,788.12 | 11.85 |
| 基金 | - | - |
| 工业 | 520,660.55 | 0.05 |
| 信息技术 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 通讯 | - | - |
| 合计 | 136,991,448.67 | 11.90 |

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

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 | 002044 | 美年健康 | 14,380,700 | 102,246,777.00 | 8.88 |
| 2 | 600150 | 中国船舶 | 3,106,229 | 102,225,996.39 | 8.88 |
| 3 | 002244 | 滨江集团 | 11,062,300 | 97,569,486.00 | 8.47 |
| 4 | 300498 | 温氏股份 | 4,998,686 | 91,725,888.10 | 7.97 |
| 5 | 002271 | 东方雨虹 | 3,345,200 | 91,190,152.00 | 7.92 |
| 6 | 300737 | 科顺股份 | 9,427,900 | 86,359,564.00 | 7.50 |
| 7 | 603737 | 三棵树 | 1,310,077 | 85,705,237.34 | 7.44 |
| 8 | 00123 | 越秀地产 | 9,723,000 | 81,665,789.13 | 7.09 |
| 9 | 300026 | 红日药业 | 10,450,041 | 56,639,222.22 | 4.92 |
| 10 | 01908 | 建发国际集团 | 3,347,000 | 54,804,998.99 | 4.76 |
| 11 | 603477 | 巨星农牧 | 1,434,300 | 47,833,905.00 | 4.15 |
| 12 | 001979 | 招商蛇口 | 2,688,600 | 35,032,458.00 | 3.04 |
| 13 | 002853 | 皮阿诺 | 1,607,842 | 27,815,666.60 | 2.42 |
| 14 | 600325 | 华发股份 | 2,691,900 | 26,515,215.00 | 2.30 |
| 15 | 002043 | 兔宝宝 | 2,043,700 | 22,296,767.00 | 1.94 |
| 16 | 002372 | 伟星新材 | 924,980 | 18,999,089.20 | 1.65 |
| 17 | 002541 | 鸿路钢构 | 512,300 | 14,759,363.00 | 1.28 |
| 18 | 002714 | 牧原股份 | 177,000 | 7,460,550.00 | 0.65 |
| 19 | 600153 | 建发股份 | 669,500 | 7,304,245.00 | 0.63 |
| 20 | 688276 | 百克生物 | 81,329 | 5,091,195.40 | 0.44 |
| 21 | 000786 | 北新建材 | 104,000 | 2,549,040.00 | 0.22 |
| 22 | 01415 | 高伟电子 | 39,000 | 520,660.55 | 0.05 |
| 23 | 301486 | 致尚科技 | 4,820 | 277,921.20 | 0.02 |
| 24 | 688249 | 晶合集成 | 7,405 | 133,734.30 | 0.01 |
| 25 | 301292 | 海科新源 | 5,824 | 116,421.76 | 0.01 |
| 26 | 301232 | 飞沃科技 | 1,643 | 99,339.12 | 0.01 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|-----------|------|
| 27 | 688472 | 阿特斯 | 5,120 | 87,244.80 | 0.01 |
| 28 | 301202 | 朗威股份 | 3,060 | 79,009.20 | 0.01 |
| 29 | 688603 | 天承科技 | 1,391 | 76,505.00 | 0.01 |
| 30 | 688469 | 中芯集成 | 13,800 | 74,658.00 | 0.01 |
| 31 | 301261 | 恒工精密 | 1,973 | 72,803.70 | 0.01 |
| 32 | 688443 | 智翔金泰 | 2,453 | 72,338.97 | 0.01 |
| 33 | 688361 | 中科飞测 | 831 | 53,740.77 | 0.00 |
| 34 | 301325 | 曼恩斯特 | 364 | 39,293.80 | 0.00 |
| 35 | 688146 | 中船特气 | 1,011 | 38,549.43 | 0.00 |
| 36 | 688576 | 西山科技 | 240 | 28,898.40 | 0.00 |
| 37 | 688352 | 颀中科技 | 2,361 | 28,497.27 | 0.00 |
| 38 | 688582 | 芯动联科 | 648 | 26,360.64 | 0.00 |
| 39 | 301293 | 三博脑科 | 333 | 23,782.86 | 0.00 |
| 40 | 301307 | 美利信 | 687 | 21,887.82 | 0.00 |
| 41 | 688543 | 国科军工 | 410 | 21,750.50 | 0.00 |
| 42 | 688458 | 美芯晟 | 221 | 20,057.96 | 0.00 |
| 43 | 688478 | 晶升股份 | 402 | 17,032.74 | 0.00 |
| 44 | 688562 | 航天软件 | 726 | 16,197.06 | 0.00 |
| 45 | 688623 | 双元科技 | 178 | 15,448.62 | 0.00 |
| 46 | 301332 | 德尔玛 | 1,122 | 15,405.06 | 0.00 |
| 47 | 301397 | 溯联股份 | 362 | 14,552.40 | 0.00 |
| 48 | 688334 | 西高院 | 888 | 14,394.48 | 0.00 |
| 49 | 688593 | 新相微 | 959 | 13,991.81 | 0.00 |
| 50 | 301320 | 豪江智能 | 642 | 13,238.04 | 0.00 |
| 51 | 688433 | 华曙高科 | 418 | 13,167.00 | 0.00 |
| 52 | 688629 | 华丰科技 | 708 | 13,161.72 | 0.00 |
| 53 | 688620 | 安凯微 | 1,016 | 12,537.44 | 0.00 |
| 54 | 301360 | 荣旗科技 | 134 | 12,408.40 | 0.00 |
| 55 | 301315 | 威士顿 | 226 | 11,553.12 | 0.00 |
| 56 | 688631 | 莱斯信息 | 336 | 10,036.32 | 0.00 |
| 57 | 688479 | 友车科技 | 332 | 9,790.68 | 0.00 |
| 58 | 301355 | 南王科技 | 563 | 9,430.25 | 0.00 |
| 59 | 301357 | 北方长龙 | 190 | 9,194.10 | 0.00 |
| 60 | 301323 | 新莱福 | 228 | 8,974.08 | 0.00 |
| 61 | 688429 | 时创能源 | 346 | 8,833.38 | 0.00 |
| 62 | 301337 | 亚华电子 | 232 | 7,045.84 | 0.00 |
| 63 | 301428 | 世纪恒通 | 229 | 7,007.40 | 0.00 |
| 64 | 001380 | 华纬科技 | 170 | 5,232.60 | 0.00 |
| 65 | 603137 | 恒尚节能 | 139 | 2,375.51 | 0.00 |
| 66 | 001324 | 长青科技 | 114 | 2,234.40 | 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末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|----------------|----------------|
| 1 | 300737 | 科顺股份 | 118,563,579.20 | 10.30 |
| 2 | 600150 | 中国船舶 | 109,750,434.49 | 9.53 |
| 3 | 603737 | 三棵树 | 109,065,658.62 | 9.47 |
| 4 | 002244 | 滨江集团 | 108,061,666.90 | 9.38 |
| 5 | 002271 | 东方雨虹 | 107,134,842.01 | 9.30 |
| 6 | 002044 | 美年健康 | 98,607,454.67 | 8.56 |
| 7 | 300498 | 温氏股份 | 97,746,615.91 | 8.49 |
| 8 | 00123 | 越秀地产 | 94,453,201.24 | 8.20 |
| 9 | 01908 | 建发国际集团 | 73,845,797.01 | 6.41 |
| 10 | 002714 | 牧原股份 | 73,379,683.63 | 6.37 |
| 11 | 600153 | 建发股份 | 71,328,955.96 | 6.19 |
| 12 | 300026 | 红日药业 | 62,683,328.24 | 5.44 |
| 13 | 001979 | 招商蛇口 | 59,545,814.40 | 5.17 |
| 14 | 603477 | 巨星农牧 | 43,203,261.08 | 3.75 |
| 15 | 002853 | 皮阿诺 | 33,493,705.98 | 2.91 |
| 16 | 600325 | 华发股份 | 31,677,070.12 | 2.75 |
| 17 | 600975 | 新五丰 | 26,993,082.00 | 2.34 |
| 18 | 688425 | 铁建重工 | 25,068,640.41 | 2.18 |
| 19 | 002043 | 兔宝宝 | 24,978,988.00 | 2.17 |
| 20 | 002372 | 伟星新材 | 20,406,930.40 | 1.77 |

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末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 002714 | 牧原股份 | 64,151,619.60 | 5.57 |
| 2 | 600153 | 建发股份 | 57,299,948.00 | 4.98 |
| 3 | 600150 | 中国船舶 | 41,557,062.00 | 3.61 |
| 4 | 688425 | 铁建重工 | 28,683,655.12 | 2.49 |
| 5 | 001979 | 招商蛇口 | 28,152,585.00 | 2.44 |
| 6 | 600975 | 新五丰 | 23,642,409.23 | 2.05 |
| 7 | 002100 | 天康生物 | 15,742,755.00 | 1.37 |
| 8 | 002508 | 老板电器 | 13,418,401.00 | 1.17 |
| 9 | 600511 | 国药股份 | 12,950,551.00 | 1.12 |
| 10 | 600079 | 人福医药 | 12,104,994.00 | 1.05 |
| 11 | 688276 | 百克生物 | 8,892,607.36 | 0.77 |
| 12 | 688169 | 石头科技 | 7,151,698.25 | 0.62 |
| 13 | 002791 | 坚朗五金 | 6,316,880.00 | 0.55 |
| 14 | 600325 | 华发股份 | 3,942,221.00 | 0.34 |
| 15 | 603486 | 科沃斯 | 2,676,852.64 | 0.23 |
| 16 | 002007 | 华兰生物 | 2,478,982.20 | 0.22 |
| 17 | 002853 | 皮阿诺 | 2,340,817.00 | 0.20 |
| 18 | 603477 | 巨星农牧 | 1,641,021.00 | 0.14 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 19 | 688249 | 晶合集成 | 1,539,291.60 | 0.13 |
| 20 | 688443 | 智翔金泰 | 786,336.20 | 0.07 |

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 | 1,505,619,095.92 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 342,632,967.77 |

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，将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，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 | 279,016.54 |
| 2 | 应收清算款 | 7,405,594.77 |
| 3 | 应收股利 | 4,934,342.43 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 17,051.55 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,636,005.29 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数 | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | |
|------|-------|-----------|-------|-------|
| | | | 机构投资者 | 个人投资者 |
| | | | | |

| | (户) | | 持有份额 | 占总份 额比例 (%) | 持有份额 | 占总 份额 比例 (%) |
|-------------------|-------|------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------------|
| 景顺长城 致远混合 A | 6,968 | 170,642.51 | 494,248.93 | 0.04 | 1,188,542,727.74 | 99.96 |
| 景顺长城 致远混合 C | 1,235 | 42,352.66 | 1,000,044.44 | 1.91 | 51,305,494.13 | 98.09 |
| 合计 | 8,203 | 151,327.87 | 1,494,293.37 | 0.12 | 1,239,848,221.87 | 99.88 |

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 | 景顺长城致远混合 A | 79,776.40 | 0.006709 |
| | 景顺长城致远混合 C | 106,500.92 | 0.203613 |
| | 合计 | 186,277.32 | 0.015006 |

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 景顺长城致远混合 A | — |
| | 景顺长城致远混合 C | — |
| | 合计 | — |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 景顺长城致远混合 A | 0~10 |
| | 景顺长城致远混合 C | — |
| | 合计 | 0~10 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 景顺长城致远混合 A | 景顺长城致远混合 C |
|--------------------------------|------------------|---------------|
| 基金合同生效日（2023 年 2 月 28 日）基金份额总额 | 1,224,955,551.33 | 56,639,396.08 |
| 基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额 | 868,016.40 | 1,215,780.91 |
| 减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额 | 36,786,591.06 | 5,549,638.42 |

| | | |
|------------------------|------------------|---------------|
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 1,189,036,976.67 | 52,305,538.57 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末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 (%) | |
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|--------------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 海通证券股份有限公司 | 1 | 445,457,999.67 | 24.22 | 409,970.65 | 24.25 | - |
| 申万宏源证券有限公司 | 1 | 248,307,076.90 | 13.50 | 231,252.01 | 13.68 | - |
| 广发证券股份有限公司 | 2 | 208,002,903.69 | 11.31 | 193,718.18 | 11.46 | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 2 | 148,058,978.57 | 8.05 | 133,182.01 | 7.88 | - |
| 招商证券股份有限公司 | 3 | 130,177,300.10 | 7.08 | 120,315.25 | 7.12 | - |
| 兴业证券股份有限公司 | 2 | 127,164,597.53 | 6.91 | 113,631.25 | 6.72 | - |
| 太平洋证券股份有限公司 | 2 | 115,093,580.68 | 6.26 | 107,185.47 | 6.34 | - |
| 中信证券股份有限公司 | 3 | 99,221,312.39 | 5.40 | 91,554.04 | 5.42 | - |
| 瑞银证券有限责任公司 | 2 | 79,258,118.07 | 4.31 | 72,204.95 | 4.27 | - |
| 长城证券股份有限公司 | 2 | 68,961,063.41 | 3.75 | 64,223.75 | 3.80 | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | 2 | 42,135,847.68 | 2.29 | 37,631.59 | 2.23 | - |
| 恒泰证券股份有限公司 | 2 | 41,425,980.12 | 2.25 | 38,580.99 | 2.28 | - |
| 华创证券有限责任公司 | 1 | 27,305,205.00 | 1.48 | 24,361.21 | 1.44 | - |
| 第一创业证券股份有限公司 | 1 | 23,052,189.01 | 1.25 | 20,315.44 | 1.20 | - |
| 中泰证券股份有限 | 1 | 19,715,955.00 | 1.07 | 18,362.78 | 1.09 | - |

| | | | | | | |
|----------------------------|---|--------------|------|----------|------|---|
| 公司 | | | | | | |
| 国信证券 股份有限 公司 | 1 | 7,349,371.00 | 0.40 | 6,844.83 | 0.40 | - |
| 安信证券 股份有限 公司 | 2 | 7,126,824.19 | 0.39 | 6,041.51 | 0.36 | - |
| 国海证券 股份有限 公司 | 1 | 910,591.60 | 0.05 | 848.12 | 0.05 | - |
| 国盛证券 有限责任 公司 | 1 | 150,716.88 | 0.01 | 140.36 | 0.01 | - |
| 国都证券 股份有限 公司 | 1 | 150,148.20 | 0.01 | 139.84 | 0.01 | - |
| 中航证券 股份有限 公司 | 1 | 92,277.40 | 0.01 | 85.94 | 0.01 | - |
| 东方财富 证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东亚前海 证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高盛（中 国）证券有 限责任公 司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 开源证券 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 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国银河 证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国中金 财富证券 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、本基金与景顺长城量化港股通股票型证券投资基金共用交易单元。

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 (%) |
| 海通证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 有限公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------------|---|---|---|---|------------|--------|
| 广发证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券股份 有限公司 | - | - | - | - | 875,719.18 | 100.00 |
| 国盛证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券股份 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 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞信证券（中国）有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国中金财富证券有限公司 | - | - | - | - | - | - |

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 | 景顺长城致远混合型证券投资基金招募说明书 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023年2月1日 |
| 2 | 景顺长城致远混合型证券投资基金基金产品资料概要 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023年2月1日 |
| 3 | 景顺长城致远混合型证券投资基金托管协议 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023年2月1日 |
| 4 | 景顺长城致远混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023年2月1日 |
| 5 | 景顺长城致远混合型证券投资基金基金合同 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023年2月1日 |
| 6 | 景顺长城致远混合型证券投资基金基金份额发售公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023年2月1日 |
| 7 | 景顺长城致远混合型证券投资基金新增广发银行等多家公司为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023年2月6日 |
| 8 | 景顺长城致远混合型证券投资基金新增腾安基金为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023年2月7日 |
| 9 | 景顺长城致远混合型证券投资基金新增平安银行为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023年2月9日 |
| 10 | 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 |
| 11 | 景顺长城致远混合型证券投资基金新 | 中国证监会指定报刊及 | 2023年2月13日 |

| | | | |
|----|----------------------------------------------------------------------------|--------------|-----------------|
| | 增南京银行和上海农商行为销售机构的公告 | 网站 | |
| 12 | 关于景顺长城致远混合型证券投资基金新增华林证券为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 2 月 20 日 |
| 13 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国元证券为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 2 月 21 日 |
| 14 | 关于旗下部分基金新增兴业银行为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 2 月 23 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 2 月 24 日 |
| 16 | 关于景顺长城致远混合型证券投资基金基金合同生效的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 3 月 1 日 |
| 17 | 关于旗下部分基金在 2023 年度新增港股通交易日照常开放申购、赎回、转换、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 3 月 6 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 3 月 25 日 |
| 19 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增好买基金为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 3 月 31 日 |
| 20 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 6 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 4 月 8 日 |
| 22 | 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 |
| 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 4 月 22 日 |
| 24 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 6 日 |
| 25 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 13 日 |
| 26 | 景顺长城致远混合型证券投资基金关于开放日常申购、赎回、转换及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 23 日 |
| 27 | 关于景顺长城致远混合型证券投资基金参加部分销售机构申购及/或定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 23 日 |
| 28 | 景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城致远混合型证券投资基金在直销 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 23 日 |

| | | | |
|----|----------------------------------------------------------------|--------------|-----------------|
| | 网上交易系统开展申购、定投和转换费率优惠活动的公告 | | |
| 29 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 23 日 |
| 30 | 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 |
| 31 | 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 |
| 32 | 关于旗下部分基金新增中国人寿为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 12 日 |
| 33 | 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 |
| 34 | 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城致远混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城致远混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城致远混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城致远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