

景顺长城价值领航两年持有期混合型证券
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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44

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	44
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	44
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	45
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城价值领航两年持有混合
基金主代码	009098
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 23 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	466,975,631.98 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，通过精选安全边际高、具备显著投资价值的股票，力争实现基金资产的长期稳定增值。
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>本基金自下而上地精选出具有高安全边际且具备投资价值的优质上市公司股票进行投资，力争在控制风险的前提下获得长期稳健的收益。</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>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 姓名	杨皞阳	王小飞

负责人	联系电话	0755-82370388	021-60637103
	电子邮箱	investor@igwfm.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4008888606	021-60637228
传真		0755-22381339	021-60635778
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		李进	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	58,595,345.10
本期利润	79,748,237.85
加权平均基金份额本期利润	0.1670
本期加权平均净值利润率	10.63%
本期基金份额净值增长率	12.14%
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	242,196,086.64
期末可供分配基金份额利润	0.5186
期末基金资产净值	752,572,122.25
期末基金份额净值	1.6115
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	61.15%

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。

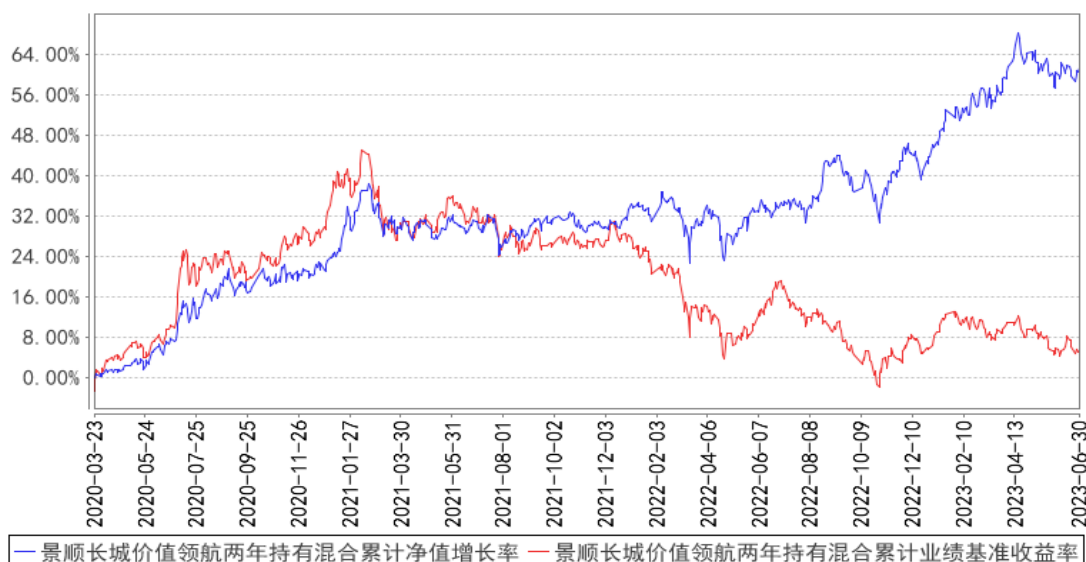
3.2 基金净值表现

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	2.32%	0.70%	0.97%	0.70%	1.35%	0.00%
过去三个月	1.03%	0.76%	-3.93%	0.67%	4.96%	0.09%
过去六个月	12.14%	0.80%	-0.29%	0.68%	12.43%	0.12%
过去一年	20.61%	0.81%	-11.23%	0.80%	31.84%	0.01%
过去三年	50.09%	0.84%	-4.86%	0.98%	54.95%	-0.14%
自基金合同生效起至今	61.15%	0.82%	5.56%	0.97%	55.59%	-0.15%

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

景顺长城价值领航两年持有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：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%—95%。本基金港股通标的股票最高投资比例不得超过股票资产的 50%。本基金投资于同业存单比例不超过基金资产的 20%。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，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 2020 年 3 月 23 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		
鲍无可	本基金的基金经理	2020年3月23日	-	15年	工学硕士。曾任平安证券有限责任公司综合研究所行业研究员。2009年12月加入本公司，历任研究部研究员、高级研究员，自2014年6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15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、《景顺长城价值领航两年持有期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

截至撰写半年报时，我们依然没有找到需要和持有人沟通的长期话题，故此次我们还是重点讨论上半年本基金的投资策略和运作分析。上半年，国内经济温和复苏，房地产销售面积不及预期。欧美经济表现强于预期，在较高的利率环境下，4 月份美国新屋销量实现正增长。

上半年，A 股市场最热门的方向仍是人工智能。去年底以来，ChatGPT 的横空出世是重大事件，其重要性不亚于上世纪九十年代互联网的出现。从长期来看，AI 的发展可能会在未来几十年重塑各个行业，甚至可能颠覆当前的世界格局。那些能够把握住 AI 机会的公司，将有望挑战现有的行业格局，同时，这也将导致企业之间的竞争变得更加不可测。当下是 AI 发展的初期，中国企业处于落后的位置，无论是 AI 核心模型的研发、新型商业模式的迭代以及底层芯片的制造，我们都希望国内企业能在不远的将来迎头赶上。

受益于 AI 的热度，本基金部分持仓在二季度大幅上涨，估值水平也随之提升，安全边际有所

下降，我们在较高的位置获利了结。基金的仓位维持稳定，持仓变化不大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年上半年，本基金份额净值增长率为 12.14%，业绩比较基准收益率为-0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，国际地缘政治的风险、居民较高的杠杆率以及国内人口老龄化或仍将是今后较长时间内的主要矛盾。但根据我们在 2021 年中期报告中的观点，我们认为持有现金并不是最佳的应对方法，长期持有股票或是更好的选择。当前全球总需求仍在稳定增长，一批优质的中国企业正在一些高价值行业进行全球扩张，我们已经看到这些主线中蕴含的投资机会。如果能找到更多合适的投资机会，本基金的仓位也将作相应提升。当前，本基金持有的上市公司均具有极高或较高的壁垒，且估值合理或偏低，我们相信这些公司有创造长期持续的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，

由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	72,260,983.07	51,143,743.62
结算备付金		419,754.83	223,643.56
存出保证金		90,542.35	75,018.40
交易性金融资产	6.4.7.2	675,955,432.82	657,973,292.94
其中：股票投资		675,955,432.82	657,973,292.94
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		22,964.50	322,494.78
应收股利		5,129,425.94	-
应收申购款		124,915.30	1,289,166.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		754,004,018.81	711,027,359.45
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		44.82	59.09
应付赎回款		344,879.15	2,160,339.42
应付管理人报酬		509,232.24	535,064.77
应付托管费		154,590.29	150,182.10
应付销售服务费		-	-
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	423,150.06	525,436.62
负债合计		1,431,896.56	3,371,082.00
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	466,975,631.98	492,428,621.73
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	285,596,490.27	215,227,655.72
净资产合计		752,572,122.25	707,656,277.45
负债和净资产总计		754,004,018.81	711,027,359.45

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值(暂估业绩报酬前)1.6115 元，基金份额总额

466,975,631.98 份，基金资产净值(暂估业绩报酬前)752,572,122.25 元，暂估业绩报酬 27,833,128.53 元，基金资产净值(暂估业绩报酬后)724,738,993.72 元。暂估业绩报酬余额是各基金份额持有人于年末时点的暂估业绩报酬的合计，各基金份额持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		88,132,348.31	-15,893,217.77
1. 利息收入		130,063.25	637,278.08
其中：存款利息收入	6.4.7.13	130,063.25	607,168.50
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		-	30,109.58
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		66,849,392.31	6,485,024.54
其中：股票投资收益	6.4.7.14	49,653,016.31	-14,310,467.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	1,791,855.27
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	17,196,376.00	19,003,636.90
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	21,152,892.75	-23,015,520.39
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	-	-

减：二、营业总支出		8,384,110.46	42,799,943.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,331,749.66	40,630,265.03
2. 托管费	6.4.10.2.2	931,172.38	2,023,894.01
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	121,188.42	145,784.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		79,748,237.85	-58,693,161.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		79,748,237.85	-58,693,161.07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		79,748,237.85	-58,693,161.07

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	492,428,621.73	-	215,227,655.72	707,656,277.45
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）	492,428,621.73	-	215,227,655.72	707,656,277.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-25,452,989.75	-	70,368,834.55	44,915,844.80
（一）、综合收	-	-	79,748,237.85	79,748,237.85

益总额				
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-25,452,989.75	-	-9,379,403.30	-34,832,393.05
其中: 1. 基金申购款	48,151,398.12	-	27,430,830.29	75,582,228.41
2. 基金赎回款	-73,604,387.87	-	-36,810,233.59	-110,414,621.46
(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)	466,975,631.98	-	285,596,490.27	752,572,122.25
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)	1,780,555,411.06	-	592,446,755.24	2,373,002,166.30
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)	1,780,555,411.06	-	592,446,755.24	2,373,002,166.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,155,665,553.63	-	-382,420,638.18	-1,538,086,191.81
(一)、综合收益总额	-	-	-58,693,161.07	-58,693,161.07

(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)	-1,155,665,553.63	-	-323,727,477.11	-1,479,393,030.74
其中：1. 基金申购款	6,299,370.21	-	2,024,790.00	8,324,160.21
2. 基金赎回款	-1,161,964,923.84	-	-325,752,267.11	-1,487,717,190.95
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	624,889,857.43	-	210,026,117.06	834,915,974.49

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

景顺长城价值领航两年持有期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[2020]243号《关于准予景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城价值领航两年持有期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1,746,158,667.16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(2020)第0172号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2020年3月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为

1,747,034,145.53 份基金份额，其中认购资金利息折合 875,478.37 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板、科创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、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、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：股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%。本基金港股通标的股票最高投资比例不得超过股票资产的 50%。本基金投资于同业存单比例不超过基金资产的 20%。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，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 X80%+中债综合指数收益率 X20%。

对于每份基金份额，在基金份额的两年持有期到期日前(不含当日)，基金份额持有人不能赎回或转换转出该基金份额；基金份额的两年持有期到期日起(含当日)，基金份额持有人可赎回或转换转出该基金份额。两年持有期起始日指基金合同生效日(对认购份额而言)、该基金份额申购申请确认日(对申购份额而言)或该基金份额转换转入确认日(对转换转入份额而言)；两年持有期到期日指该基金份额两年持有期起始日两年后的年度对应日。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

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

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

中抵减。

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	72,260,983.07
等于：本金	72,255,060.13
加：应计利息	5,922.94
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	72,260,983.07

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	622,304,935.02	-	675,955,432.82	53,650,497.80
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	622,304,935.02	-	675,955,432.82	53,650,497.80

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	239,471.11
其中：交易所市场	239,471.11
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	183,678.95
合计	423,150.06

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	492,428,621.73	492,428,621.73
本期申购	48,151,398.12	48,151,398.12
本期赎回 (以“-”号填列)	-73,604,387.87	-73,604,387.87
本期末	466,975,631.98	466,975,631.98

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	190,782,958.79	24,444,696.93	215,227,655.72
本期利润	58,595,345.10	21,152,892.75	79,748,237.85
本期基金份额交易产生的变动数	-7,182,217.25	-2,197,186.05	-9,379,403.30
其中：基金申购款	21,998,715.35	5,432,114.94	27,430,830.29
基金赎回款	-29,180,932.60	-7,629,300.99	-36,810,233.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	242,196,086.64	43,400,403.63	285,596,490.27

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	111,698.88
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	17,423.69
其他	940.68
合计	130,063.25

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	49,653,016.31
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	49,653,016.31

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	470,331,599.72
减：卖出股票成本总额	419,146,074.03
减：交易费用	1,532,509.38
买卖股票差价收入	49,653,016.31

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

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	17,196,376.00
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	17,196,376.00

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	21,152,892.75
股票投资	21,152,892.75
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	21,152,892.75

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

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	-
债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	3,509.20
其他	360.00
证券组合费	9,140.27
合计	121,188.42

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
长城证券	167,811.00	0.02	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	156.28	0.02	156.28	0.07
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	7,331,749.66	40,630,265.03
其中：支付销售机构的客户维护费	1,277,556.86	2,734,913.73

注：1. 本基金本期共发生应支付的固定管理费 2,979,751.58 元。支付基金管理人的固定管理费按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日固定管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

2. 本基金本期共发生应支付的业绩报酬 4,351,998.08 元。上述金额于相应的基金赎回确认日按投资者赎回申请日的基金实际收益情况计算确认。业绩报酬计提日为基金份额持有人赎回日或本基金终止运作日。

业绩报酬的计算公式为：
$$R = \frac{V_1 - V_0}{V_0^*} \times 365 \div T \times 100\%$$

V_1 为业绩报酬计提截止日适用的基金份额累计净值；

V_0 为申购申请日适用的基金份额累计净值，基金合同生效日的基金份额净值为 1.00 元（下同）；

V_0^* 为申购申请日适用的基金份额净值；

T 为该笔基金份额此次计提业绩报酬区间内的持有天数：即，T 为申购申请日至业绩报酬计提截止日的持有期间；

R 为每笔基金份额在此业绩报酬计提期间的年化收益率。

每笔基金份额的业绩报酬计算方式如下：

年化收益率(R)	区间计提比例	每笔基金份额的业绩报酬(Y)的计提公式
R < 8%	0	Y = 0

8%≤R	20%	$Y = F \times V_0^* \times (R - 8\%) \times 20\% \times T \div 365$
------	-----	---

F 为该笔基金份额的基金份额持有量；

Y 为每笔基金份额应计提的业绩报酬。

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	931,172.38	2,023,894.01

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 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期	72,260,983.07	111,698.88	70,463,624.79	551,443.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

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
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,045	12,414.60	21,965.90	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内（含）	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-

301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	875	43,750.00	26,871.25	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月以上	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股流通受限	131.11	53.24	243	31,859.73	12,937.32	-
301322	绿通科技	2023年5月25日	1-6个月(含)	新股流通受限	-	53.24	121	-	6,442.04	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	6个月	新股流通	23.77	42.89	901	21,416.77	38,643.89	-

		1 日		受限						
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通 受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通 受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通 受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通 受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流通 受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股流通 受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通 受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通 受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通 受限	6.58	7.58	2,306	15,173.48	17,479.48	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通 受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通 受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通 受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通 受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 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	692	25,015.80	26,385.96	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通 受限	19.86	18.06	4,727	93,878.22	85,369.62	-
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	2,153	26,051.30	25,986.71	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通 受限	23.60	64.67	771	18,195.60	49,860.57	-

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	1,612	61,062.56	47,537.88	-
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	8,922	50,766.18	48,268.02	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	3,297	36,596.70	56,180.88	-
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	-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	254	38,704.52	34,536.38	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	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

截至本报告期末，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

截至本报告期末，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（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短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	72,260,983.07	-	-	-	-	-	72,260,983.07
结算备付金	419,754.83	-	-	-	-	-	419,754.83
存出保证金	90,542.35	-	-	-	-	-	90,542.35
交易性金融资产	-	-	-	-	-	675,955,432.82	675,955,432.82
应收股利	-	-	-	-	-	5,129,425.94	5,129,425.94
应收申购款	-	-	-	-	-	124,915.30	124,915.30
应收证券清算款	-	-	-	-	-	22,964.50	22,964.50
资产总计	72,771,280.25	-	-	-	-	681,232,738.56	754,004,018.81
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	344,879.15	344,879.15

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	509,232.24	509,232.24
应付托管费	-	-	-	-	-	154,590.29	154,590.29
应付证券清算款	-	-	-	-	-	44.82	44.82
其他负债	-	-	-	-	-	423,150.06	423,150.06
负债总计	-	-	-	-	-	1,431,896.56	1,431,896.56
利率敏感度缺口	72,771,280.25	-	-	-	-	-	-
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	51,143,743.62	-	-	-	-	-	51,143,743.62
结算备付金	223,643.56	-	-	-	-	-	223,643.56
存出保证金	75,018.40	-	-	-	-	-	75,018.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-657,973,292.94	657,973,292.94
应收申购款	-	-	-	-	-	1,289,166.15	1,289,166.15
应收证券清算款	-	-	-	-	-	322,494.78	322,494.78
资产总计	51,442,405.58	-	-	-	-	-659,584,953.87	711,027,359.45
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,160,339.42	2,160,339.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	535,064.77	535,064.77
应付托管费	-	-	-	-	-	150,182.10	150,182.10
应付证券清算款	-	-	-	-	-	59.09	59.09
其他负债	-	-	-	-	-	525,436.62	525,436.62
负债总计	-	-	-	-	-	3,371,082.00	3,371,082.00
利率敏感度缺口	51,442,405.58	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有债券资产（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				

交易性金融资产	-	204,702,914.31	-	204,702,914.31
资产合计	-	204,702,914.31	-	204,702,914.31
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	-	204,702,914.31	-	204,702,914.31
项目	上年度末 2022年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	271,357,766.09	-	271,357,766.09
资产合计	-	271,357,766.09	-	271,357,766.09
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	-	271,357,766.09	-	271,357,766.09

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 (2023年6月30日)	上年度末 (2022年12月31日)
	所有外币相对人民币升值5%	10,235,145.72	13,567,888.30
	所有外币相对人民币贬值5%	-10,235,145.72	-13,567,888.30

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	675,955,432.82	89.82	657,973,292.94	92.98
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	675,955,432.82	89.82	657,973,292.94	92.98

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%	22,448,238.55	21,251,673.63
	沪深 300 指数下降 5%	-22,448,238.55	-21,251,673.63

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	674,140,858.77	656,699,963.98
第二层次	654,683.90	-

第三层次	1,159,890.15	1,273,328.96
合计	675,955,432.82	657,973,292.94

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	675,955,432.82	89.65
	其中：股票	675,955,432.82	89.65
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	72,680,737.90	9.64

8	其他各项资产	5,367,848.09	0.71
9	合计	754,004,018.81	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 204,702,914.31 元，占基金资产净值比例为 27.20%。

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	-	-
B	采矿业	61,267,245.00	8.14
C	制造业	249,468,344.35	33.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	134,851,677.32	17.92
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	22,956,013.43	3.05
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	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	476,544.48	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	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	2,152,807.36	0.29
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	471,252,518.51	62.62

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	19,868,881.06	2.64
周期性消费品	8,149,123.07	1.08
非周期性消费品	11,373,540.67	1.51
综合	-	-
能源	99,324,315.33	13.20
金融	3,291,061.45	0.44
基金	-	-
工业	12,594,873.75	1.67

信息科技	-	-
公用事业	-	-
通讯	50,101,118.98	6.66
合计	204,702,914.31	27.20

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	600674	川投能源	4,733,897	71,245,149.85	9.47
2	00883	中国海洋石油	6,511,000	67,233,731.94	8.93
3	600025	华能水电	8,916,000	63,571,080.00	8.45
4	601899	紫金矿业	5,388,500	61,267,245.00	8.14
5	00941	中国移动	638,000	37,675,698.52	5.01
6	00857	中国石油股份	4,778,000	23,876,294.78	3.17
7	300294	博雅生物	637,200	23,117,616.00	3.07
8	600546	山煤国际	1,582,700	22,901,669.00	3.04
9	300760	迈瑞医疗	76,131	22,824,073.80	3.03
10	000630	铜陵有色	7,834,600	22,641,994.00	3.01
11	01818	招金矿业	2,203,500	19,868,881.06	2.64
12	603599	广信股份	680,020	18,414,941.60	2.45
13	002318	久立特材	1,005,700	17,127,071.00	2.28
14	01138	中远海能	1,738,000	12,594,873.75	1.67
15	00700	腾讯控股	40,642	12,425,420.46	1.65
16	002262	恩华药业	384,700	11,860,301.00	1.58
17	300833	浩洋股份	100,600	11,008,658.00	1.46
18	01448	福寿园	2,118,000	10,525,342.12	1.40
19	300470	中密控股	188,100	8,693,982.00	1.16
20	000333	美的集团	141,900	8,360,748.00	1.11
21	01088	中国神华	372,000	8,214,288.61	1.09
22	600690	海尔智家	349,500	8,206,260.00	1.09
23	01585	雅迪控股	496,000	8,149,123.07	1.08
24	000933	神火股份	567,862	7,382,206.00	0.98
25	605507	国邦医药	336,300	7,153,101.00	0.95
26	002484	江海股份	332,200	7,072,538.00	0.94
27	002444	巨星科技	320,700	7,016,916.00	0.93
28	605183	确成股份	353,800	6,403,780.00	0.85
29	603855	华荣股份	229,579	6,106,801.40	0.81
30	600060	海信视像	203,430	5,034,892.50	0.67
31	002182	云海金属	217,800	4,789,422.00	0.64
32	300395	菲利华	84,900	4,177,080.00	0.56
33	603281	江瀚新材	122,460	3,781,564.80	0.50
34	603043	广州酒家	132,880	3,755,188.80	0.50

35	688269	凯立新材	51,886	3,309,807.94	0.44
36	605377	华旺科技	183,200	3,306,760.00	0.44
37	00388	香港交易所	12,092	3,291,061.45	0.44
38	000902	新洋丰	298,707	3,070,707.96	0.41
39	688768	容知日新	31,323	2,501,768.01	0.33
40	600301	华锡有色	132,300	2,374,785.00	0.32
41	002020	京新药业	179,800	2,305,036.00	0.31
42	603882	金城医学	28,199	2,129,024.50	0.28
43	002254	泰和新材	72,200	1,766,734.00	0.23
44	000893	亚钾国际	65,700	1,507,158.00	0.20
45	002801	微光股份	55,515	1,502,235.90	0.20
46	603896	寿仙谷	32,300	1,430,890.00	0.19
47	603100	川仪股份	25,900	1,006,474.00	0.13
48	603556	海兴电力	35,100	885,924.00	0.12
49	300979	华利集团	17,700	862,698.00	0.11
50	02269	药明生物	24,500	848,198.55	0.11
51	600031	三一重工	48,400	804,892.00	0.11
52	002597	金禾实业	32,200	759,920.00	0.10
53	000738	航发控制	24,900	607,560.00	0.08
54	002415	海康威视	18,000	595,980.00	0.08
55	603899	晨光股份	13,200	589,248.00	0.08
56	600380	健康元	39,700	504,587.00	0.07
57	300627	华测导航	14,700	477,309.00	0.06
58	300357	我武生物	13,800	464,094.00	0.06
59	300012	华测检测	23,700	462,150.00	0.06
60	002332	仙琚制药	33,800	447,850.00	0.06
61	300910	瑞丰新材	8,550	430,065.00	0.06
62	300888	稳健医疗	9,520	396,698.40	0.05
63	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.04
64	603833	欧派家居	3,100	296,980.00	0.04
65	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.04
66	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
67	002028	思源电气	1,900	88,768.00	0.01
68	688249	晶合集成	4,727	85,369.62	0.01
69	002709	天赐材料	2,000	82,380.00	0.01
70	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
71	002706	良信股份	6,900	77,625.00	0.01
72	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
73	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
74	688102	斯瑞新材	5,781	70,528.20	0.01
75	300408	三环集团	2,300	67,505.00	0.01
76	002859	洁美科技	2,400	66,480.00	0.01
77	688472	阿特斯	3,297	56,180.88	0.01

78	688361	中科飞测	771	49,860.57	0.01
79	688469	中芯集成	8,922	48,268.02	0.01
80	688443	智翔金泰	1,612	47,537.88	0.01
81	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.01
82	301358	湖南裕能	901	38,643.89	0.01
83	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
84	688531	日联科技	254	34,536.38	0.00
85	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
86	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
87	301246	宏源药业	875	26,871.25	0.00
88	688146	中船特气	692	26,385.96	0.00
89	688352	颀中科技	2,153	25,986.71	0.00
90	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
91	001287	中电港	1,045	21,965.90	0.00
92	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
93	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
94	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
95	301322	绿通科技	364	19,379.36	0.00
96	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
97	601061	中信金属	2,306	17,479.48	0.00
98	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
99	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
100	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
101	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
102	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
103	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
104	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
105	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
106	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
107	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
108	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
109	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
110	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
111	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
112	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
113	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
114	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
115	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
116	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
117	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
118	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
119	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
120	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00

121	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
122	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
123	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
124	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
125	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
126	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
127	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
128	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
129	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
130	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
131	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
132	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
133	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
134	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
135	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
136	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
137	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
138	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
139	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	601899	紫金矿业	39,805,878.00	5.63
2	00941	中国移动	34,747,230.25	4.91
3	000630	铜陵有色	33,184,646.00	4.69
4	600546	山煤国际	23,459,288.00	3.32
5	01171	兖矿能源	23,224,041.54	3.28
6	300760	迈瑞医疗	19,876,800.85	2.81
7	02269	药明生物	15,896,437.34	2.25
8	000807	云铝股份	15,065,552.00	2.13
9	002318	久立特材	14,985,641.00	2.12
10	603599	广信股份	12,824,898.20	1.81
11	000933	神火股份	12,807,746.94	1.81
12	002180	纳思达	12,686,188.86	1.79
13	601699	潞安环能	8,742,118.00	1.24
14	01088	中国神华	8,547,875.27	1.21
15	300394	天孚通信	7,950,329.00	1.12
16	002444	巨星科技	6,186,995.00	0.87
17	300470	中密控股	6,049,147.92	0.85
18	002484	江海股份	5,580,141.00	0.79
19	300308	中际旭创	5,356,976.00	0.76
20	002182	云海金属	5,256,861.00	0.74

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	601928	凤凰传媒	66,793,146.90	9.44
2	00728	中国电信	46,466,919.15	6.57
3	00941	中国移动	39,625,047.94	5.60
4	00857	中国石油股份	28,864,056.14	4.08
5	01171	兖矿能源	23,850,994.90	3.37
6	000807	云铝股份	16,736,748.00	2.37
7	01818	招金矿业	14,961,639.52	2.11
8	601098	中南传媒	14,788,790.00	2.09
9	02269	药明生物	12,881,032.03	1.82
10	300394	天孚通信	12,026,583.26	1.70
11	002463	沪电股份	10,767,569.40	1.52
12	600161	天坛生物	10,556,801.40	1.49
13	002180	纳思达	9,674,236.00	1.37
14	000933	神火股份	9,656,679.00	1.36
15	600989	宝丰能源	8,094,780.00	1.14
16	000630	铜陵有色	7,477,305.00	1.06
17	601699	潞安环能	7,161,529.00	1.01
18	01691	JS 环球生活	7,124,479.99	1.01
19	01138	中远海能	6,727,847.25	0.95
20	600674	川投能源	6,292,725.00	0.89

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	415,200,780.22
卖出股票收入（成交）总额	470,331,599.72

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	90,542.35
2	应收清算款	22,964.50
3	应收股利	5,129,425.94

4	应收利息	-
5	应收申购款	124,915.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,367,848.09

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 (%)
14,308	32,637.38	2,199,221.71	0.47	464,776,410.27	99.53

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	39,236.27	0.008402

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	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020 年 3 月 23 日) 基金份额总额	1,747,034,145.53
本报告期期初基金份额总额	492,428,621.73
本报告期基金总申购份额	48,151,398.12
减：本报告期基金总赎回份额	73,604,387.87

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	466,975,631.98

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中泰证券股份有	2	116,934,358.75	13.40	97,976.67	12.65	-

限公司						
华金证券股份有 限公司	2	106,406,150.97	12.19	92,678.48	11.97	-
渤海证券股份有 限公司	1	99,623,054.46	11.41	86,464.73	11.16	-
东方证券股份有 限公司	1	97,851,018.16	11.21	84,663.71	10.93	-
光大证券股份有 限公司	2	87,371,380.67	10.01	79,097.82	10.21	-
华创证券有限责 任公司	1	62,389,104.22	7.15	58,102.15	7.50	-
天风证券股份有 限公司	1	61,730,468.12	7.07	57,490.12	7.42	-
中信证券股份有 限公司	4	51,795,722.40	5.93	45,731.92	5.90	-
国信证券股份有 限公司	2	50,101,766.60	5.74	46,659.88	6.02	-
中信建投证券股 份有限公司	2	31,562,788.33	3.62	27,085.83	3.50	-
东北证券股份有 限公司	1	30,735,856.71	3.52	28,626.43	3.70	-
广发证券股份有 限公司	1	21,548,102.01	2.47	20,066.01	2.59	-
西部证券股份有 限公司	2	18,118,800.58	2.08	16,315.79	2.11	-
长江证券股份有 限公司	1	16,966,688.83	1.94	15,124.34	1.95	-
招商证券股份有 限公司	1	13,295,041.23	1.52	12,381.93	1.60	-
东方财富证券股 份有限公司	2	3,544,227.81	0.41	3,300.48	0.43	-
安信证券股份有 限公司	1	2,789,907.00	0.32	2,598.31	0.34	-
长城证券股份有 限公司	2	167,811.00	0.02	156.28	0.02	-
方正证券股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
-------	--	--	--	--	--	--

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 (%)
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年非港股通交易日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回及转换业务安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 4 日
2	景顺长城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 1 月 17 日
3	景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报刊及	2023 年 1 月 20 日

	基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	网站	
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 10 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 20 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 24 日
8	关于旗下部分基金在 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
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 25 日
10	景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
12	景顺长城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
13	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 8 日
14	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
15	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
16	景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于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
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 5 月 6 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 13 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 5 月 23 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 5 月 27 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 10 日
23	关于旗下部分基金新增杭州银行股份	中国证监会指定报刊及	2023 年 6 月 16 日

	有限公司杭 e 家平台为销售平台并开通基金转换业务及参加申购费率优惠的公告	网站	
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 17 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增开源证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 20 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 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价值领航两年持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城价值领航两年持有期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