

景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资
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：招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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 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	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	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
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	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49

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	49
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	49
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	56
§ 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	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
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	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城量化平衡混合
场内简称	无
基金主代码	005258
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 27 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	61,907,864.75 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型精选股票，在严格控制风险及考虑流动性的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金依据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，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，形成资产配置方案。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。</p> <p>3、固定收益类投资策略</p> <p>通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券及现金管理工具资产配置。</p> <p>4、股指期货、国债期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。</p> <p>5、中小企业私募债券投资策略</p> <p>在信用研究方面，本基金将加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽的调研和分析。</p> <p>6、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，</p>

	综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，考虑选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+一年期人民币定期存款利率(税后)×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高预期收益和风险水平的投资品种，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皦阳	张姗
	联系电话	0755-82370388	0755-83077987
	电子邮箱	investor@igwfm.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008888606	95555
传真		0755-22381339	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		李进	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-5,691,741.09
本期利润	-2,406,777.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0299
本期加权平均净值利润率	-2.27%
本期基金份额净值增长率	-2.46%
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	16,280,110.40
期末可供分配基金份额利润	0.2630
期末基金资产净值	78,187,975.15
期末基金份额净值	1.2630
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	26.30%

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。

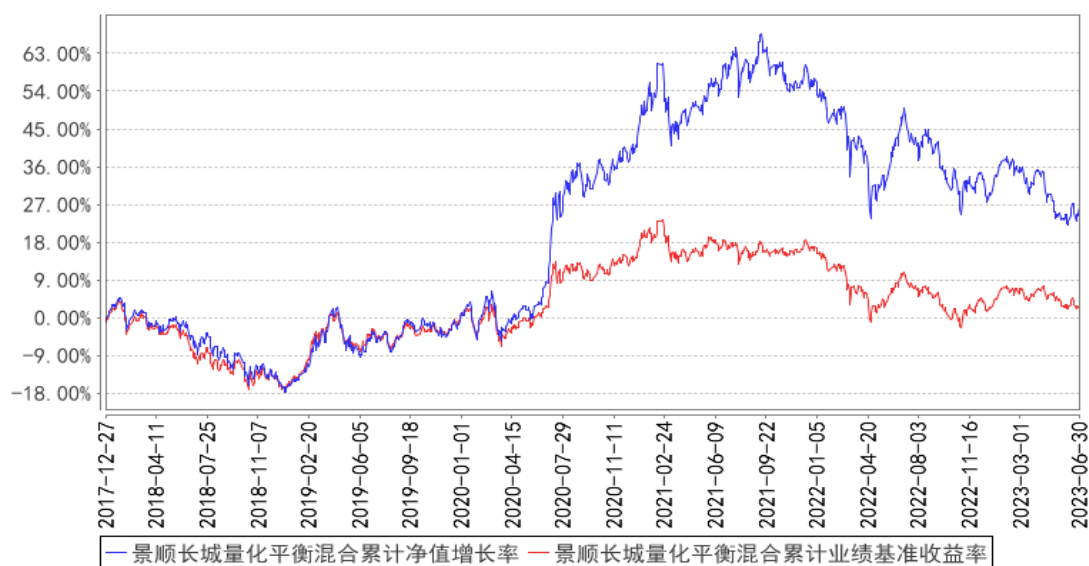
3.2 基金净值表现

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	2.33%	0.86%	0.45%	0.52%	1.88%	0.34%
过去三个月	-6.06%	0.77%	-2.97%	0.48%	-3.09%	0.29%
过去六个月	-2.46%	0.76%	0.40%	0.48%	-2.86%	0.28%
过去一年	-14.63%	0.86%	-6.96%	0.57%	-7.67%	0.29%
过去三年	14.69%	1.08%	-0.40%	0.70%	15.09%	0.38%
自基金合同生效起至今	26.30%	1.03%	2.88%	0.75%	23.42%	0.28%

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

景顺长城量化平衡混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自 2017 年 12 月 27 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2023 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 175 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黎海威	本基金的基金经理	2017 年 12 月 27 日	-	20 年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有 20 年证券、基金行业从业经验。
徐喻军	本基金的基金经理	2017 年 12 月 27 日	-	13 年	理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员，自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 13 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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城量化平衡灵活配置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

2023 年上半年，国内经济整体呈现出弱复苏的态势，服务业的复苏较为明显，制造业和地产的复苏仍需观察，权益市场的表现也反映了较弱的经济和基本面预期。从国内来看，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 49.2、48.8、49.0，今年前 5 个月工业增加值累计同比增长 3.6%，其中 5 月份工业增加值当月同比增长 3.5%，经济复苏的节奏出现放缓的迹象。6 月 PPI 同比下降 5.4%，环比下降 0.8%；CPI 同比持平，环比下降 0.2%，通胀依旧温和。6 月 M2 同比增长 11.3%，M1 同比增速 3.1%，流动性充裕；6 月末外汇储备 3.19 万亿美元，汇率短期承压。整体而言，国内货币政策总体保持稳健，流动性充裕，宏观环境总体温和，经济依然是弱复苏的态势。上半年 A 股市场呈现出先涨后跌的态势，风格上来看，价值风格优于成长风格。综合来看，上半年上证指数上涨 3.65%、沪深 300 指数下跌 0.75%，创业板指数下跌 5.61%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年上半年，本基金份额净值增长率为-2.46%，业绩比较基准收益率为 0.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，海外方面，通胀大概率继续回落，美联储的货币政策依然是市场关注的热点，但其对国内资本市场的边际影响明显降低。国内方面，“稳增长”政策有望加快落地，或可对经济形成一定支撑，下半年货币政策预期维持宽松，预期流动性保持合理充裕。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的

行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。组合仍主要以选股作为主要的收益来源，在价值和成长之间保持平衡，重点关注估值合理、业绩表现稳健的价值蓝筹以及白马成长股。

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应用性的情况时，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合规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城量化平衡灵活配置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	6,325,166.33	9,736,947.25
结算备付金		1,762,490.03	1,683,365.56
存出保证金		22,679.02	21,227.97
交易性金融资产	6.4.7.2	70,852,425.68	104,892,373.42
其中：股票投资		70,852,425.68	104,892,373.42
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		-	72,615.66
应收股利		-	-
应收申购款		3,053.94	1,888.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		78,965,815.00	116,408,418.13
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		-	8.38
应付赎回款		12,066.37	850,663.00
应付管理人报酬		96,659.38	143,003.01
应付托管费		16,109.92	23,833.86
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	653,004.18	658,370.89
负债合计		777,839.85	1,675,879.14
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	61,907,864.75	88,610,818.19
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	16,280,110.40	26,121,720.80
净资产合计		78,187,975.15	114,732,538.99
负债和净资产总计		78,965,815.00	116,408,418.13

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.2630 元，基金份额总额 61,907,864.75 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化平衡灵活配置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		-1,379,345.53	-12,085,609.34
1. 利息收入		28,881.87	41,454.09
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,881.87	41,454.09
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）		-4,745,579.60	-21,942,865.50
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,602,423.75	-23,647,709.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	27,533.34	119,911.15
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	829,310.81	1,584,932.83
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	3,284,963.72	9,602,665.00
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	52,388.48	213,137.07
减：二、营业总支出		1,027,431.84	1,623,168.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	790,075.77	1,299,259.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	131,679.36	216,543.13
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		0.03	0.17
8. 其他费用	6.4.7.23	105,676.68	107,365.83

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,406,777.37	-13,708,777.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,406,777.37	-13,708,777.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,406,777.37	-13,708,777.74

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城量化平衡灵活配置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）	88,610,818.19	-	26,121,720.80	114,732,538.99
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）	88,610,818.19	-	26,121,720.80	114,732,538.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-26,702,953.44	-	-9,841,610.40	-36,544,563.84
（一）、综合收益总额	-	-	-2,406,777.37	-2,406,777.37
（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）	-26,702,953.44	-	-7,434,833.03	-34,137,786.47
其中：1. 基金申购款	1,240,427.99	-	405,497.10	1,645,925.09
2. 基金赎回款	-27,943,381.43	-	-7,840,330.13	-35,783,711.56
（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)	61,907,864.75	-	16,280,110.40	78,187,975.15
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	152,060,019.64	-	86,787,518.92	238,847,538.56
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)	152,060,019.64	-	86,787,518.92	238,847,538.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-37,078,928.34	-	-31,664,462.59	-68,743,390.93
(一)、综合收益总额	-	-	-13,708,777.74	-13,708,777.74
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-37,078,928.34	-	-17,955,684.85	-55,034,613.19
其中：1. 基金申购款	23,166,134.77	-	9,584,976.17	32,751,110.94
2. 基金赎回款	-60,245,063.11	-	-27,540,661.02	-87,785,724.13
(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)	114,981,091.30	-	55,123,056.33	170,104,147.63

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：

<u>康乐</u>	<u>吴建军</u>	<u>邵媛媛</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1790 号文《关于准予景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2017 年 12 月 27 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,252,010,880.63 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 613,522.59 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,252,624,403.22 元，折合 1,252,624,403.22 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、债券回购等）、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×60%+一年期人民币定期存款利率（税后）×40%。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题

的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

（2）增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

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

（3）企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题

的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

(4) 个人所得税

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	6,325,166.33
等于：本金	6,324,540.16
加：应计利息	626.17
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	6,325,166.33

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	70,479,830.69	-	70,852,425.68	372,594.99
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	70,479,830.69	-	70,852,425.68	372,594.99

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末的买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	21.16
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	559,680.46
其中：交易所市场	559,680.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	93,302.56
合计	653,004.18

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	88,610,818.19	88,610,818.19
本期申购	1,240,427.99	1,240,427.99
本期赎回 (以“-”号填列)	-27,943,381.43	-27,943,381.43
本期末	61,907,864.75	61,907,864.75

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	46,823,414.58	-20,701,693.78	26,121,720.80
本期利润	-5,691,741.09	3,284,963.72	-2,406,777.37
本期基金份额交易产生的变动数	-13,257,282.51	5,822,449.48	-7,434,833.03
其中：基金申购款	648,930.55	-243,433.45	405,497.10
基金赎回款	-13,906,213.06	6,065,882.93	-7,840,330.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,874,390.98	-11,594,280.58	16,280,110.40

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	14,741.76
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	13,980.02
其他	160.09
合计	28,881.87

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	-5,602,423.75
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	-5,602,423.75
----	---------------

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	558,728,183.39
减：卖出股票成本总额	562,683,074.30
减：交易费用	1,647,532.84
买卖股票差价收入	-5,602,423.75

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	12.92
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	27,520.42
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	27,533.34

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	103,537.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	76,000.00
减：应计利息总额	13.20
减：交易费用	4.19
买卖债券差价收入	27,520.42

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	829,310.81
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	829,310.81

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	3,284,963.72
股票投资	3,284,963.72
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	3,284,963.72

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	51,741.89
基金转换费收入	646.59
合计	52,388.48

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	18,600.00
银行划款手续费	2,774.12
合计	105,676.68

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	790,075.77	1,299,259.27
其中：支付销售机构的客户维护费	315,339.08	386,590.43

注：基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	131,679.36	216,543.13

注：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		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
招商银行-活期	6,325,166.33	14,741.76	14,698,813.72	26,498.95

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688485	九州一轨	2023年1月11日	6个月	新股流通受限	17.47	15.17	1,822	31,830.34	27,639.74	-

688522	纳睿雷达	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流通受限	46.68	51.50	760	35,476.80	39,140.00	-
--------	------	-----------------	------	--------	-------	-------	-----	-----------	-----------	---

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

于本报告期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券（上年度末：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发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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

投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日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 个工作日内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	6,325,166.33	-	-	-	-	-	6,325,166.33
结算备付金	1,762,490.03	-	-	-	-	-	1,762,490.03
存出保证金	22,679.02	-	-	-	-	-	22,679.02
交易性金融资产	-	-	-	-	-	70,852,425.68	70,852,425.68
应收申购款	-	-	-	-	-	3,053.94	3,053.94
资产总计	8,110,335.38	-	-	-	-	70,855,479.62	78,965,815.00

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,066.37	12,066.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	96,659.38	96,659.38
应付托管费	-	-	-	-	-	16,109.92	16,109.92
其他负债	-	-	-	-	-	653,004.18	653,004.18
负债总计	-	-	-	-	-	777,839.85	777,839.85
利率敏感度缺口	8,110,335.38	-	-	-	-	-	-
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	9,736,947.25	-	-	-	-	-	9,736,947.25
结算备付金	1,683,365.56	-	-	-	-	-	1,683,365.56
存出保证金	21,227.97	-	-	-	-	-	21,227.97
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-104,892,373.42	104,892,373.42
应收申购款	-	-	-	-	-	1,888.27	1,888.27
应收证券清算款	-	-	-	-	-	72,615.66	72,615.66
资产总计	11,441,540.78	-	-	-	-	-104,966,877.35	116,408,418.13
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	850,663.00	850,663.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	143,003.01	143,003.01
应付托管费	-	-	-	-	-	23,833.86	23,833.86
应付证券清算款	-	-	-	-	-	8.38	8.38
其他负债	-	-	-	-	-	658,370.89	658,370.89
负债总计	-	-	-	-	-	1,675,879.14	1,675,879.14
利率敏感度缺口	11,441,540.78	-	-	-	-	-	-

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	70,852,425.68	90.62	104,892,373.42	91.42
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	70,852,425.68	90.62	104,892,373.42	91.42

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%	3,065,534.66	4,237,963.65
	沪深 300 指数下降 5%	-3,065,534.66	-4,237,963.65

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	70,785,645.94	104,588,317.88

第二层次	-	-
第三层次	66,779.74	304,055.54
合计	70,852,425.68	104,892,373.42

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	70,852,425.68	89.73
	其中：股票	70,852,425.68	89.73
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	8,087,656.36	10.24
8	其他各项资产	25,732.96	0.03
9	合计	78,965,815.00	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	400,830.00	0.51
B	采矿业	2,325,571.00	2.97
C	制造业	48,580,208.10	62.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,215,512.00	1.55
E	建筑业	1,443,434.40	1.85
F	批发和零售业	905,499.78	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	828,739.00	1.06
H	住宿和餐饮业	286,145.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,584,518.70	9.70
J	金融业	3,082,349.36	3.94
K	房地产业	703,700.00	0.90
L	租赁和商务服务业	1,014,524.00	1.30
M	科学研究和技术服务业	867,748.60	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	253,345.74	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	182,114.00	0.23
Q	卫生和社会工作	356,211.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	382,007.00	0.49
S	综合	439,968.00	0.56
	合计	70,852,425.68	90.62

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	3,900	637,923.00	0.82
2	000063	中兴通讯	12,900	587,466.00	0.75
3	300896	爱美客	1,200	533,940.00	0.68
4	600519	贵州茅台	300	507,300.00	0.65
5	688012	中微公司	3,100	484,995.00	0.62
6	600570	恒生电子	10,840	480,103.60	0.61
7	002371	北方华创	1,500	476,475.00	0.61
8	601318	中国平安	10,000	464,000.00	0.59
9	600809	山西汾酒	2,300	425,661.00	0.54

10	603688	石英股份	3,600	409,824.00	0.52
11	002475	立讯精密	12,600	408,870.00	0.52
12	000568	泸州老窖	1,900	398,183.00	0.51
13	300856	科思股份	5,000	393,850.00	0.50
14	688599	天合光能	9,100	387,751.00	0.50
15	002273	水晶光电	32,200	384,468.00	0.49
16	688390	固德威	2,300	383,778.00	0.49
17	688111	金山办公	800	377,776.00	0.48
18	688556	高测股份	7,100	377,294.00	0.48
19	600211	西藏药业	6,200	368,280.00	0.47
20	002182	云海金属	16,400	360,636.00	0.46
21	300760	迈瑞医疗	1,200	359,760.00	0.46
22	002044	美年健康	50,100	356,211.00	0.46
23	600919	江苏银行	48,100	353,535.00	0.45
24	300855	图南股份	9,920	350,374.40	0.45
25	002402	和而泰	20,500	348,090.00	0.45
26	301117	佳缘科技	5,300	342,486.00	0.44
27	688072	拓荆科技	800	340,776.00	0.44
28	002698	博实股份	19,400	339,306.00	0.43
29	300416	苏试试验	15,660	337,629.60	0.43
30	300037	新宙邦	6,500	337,285.00	0.43
31	002410	广联达	10,380	337,246.20	0.43
32	601882	海天精工	10,100	336,330.00	0.43
33	600150	中国船舶	10,200	335,682.00	0.43
34	002409	雅克科技	4,600	335,248.00	0.43
35	601888	中国中免	3,000	331,590.00	0.42
36	002384	东山精密	12,800	331,520.00	0.42
37	300750	宁德时代	1,420	324,881.80	0.42
38	688036	传音控股	2,200	323,400.00	0.41
39	600732	爱旭股份	10,500	322,875.00	0.41
40	688981	中芯国际	6,200	313,224.00	0.40
41	688305	科德数控	3,100	310,806.00	0.40
42	600566	济川药业	10,700	310,728.00	0.40
43	603596	伯特利	3,900	309,114.00	0.40
44	600039	四川路桥	31,440	308,426.40	0.39
45	601688	华泰证券	21,800	300,186.00	0.38
46	002050	三花智控	9,800	296,548.00	0.38
47	601336	新华保险	8,048	295,924.96	0.38
48	600258	首旅酒店	15,100	286,145.00	0.37
49	002594	比亚迪	1,100	284,097.00	0.36
50	002179	中航光电	6,200	281,170.00	0.36
51	002737	葵花药业	11,500	279,910.00	0.36
52	002049	紫光国微	3,000	279,750.00	0.36

53	600183	生益科技	19,600	278,320.00	0.36
54	000048	京基智农	14,200	277,184.00	0.35
55	601021	春秋航空	4,800	275,856.00	0.35
56	600212	绿能慧充	28,800	270,144.00	0.35
57	600600	青岛啤酒	2,600	269,438.00	0.34
58	002422	科伦药业	9,000	267,120.00	0.34
59	600750	江中药业	12,000	263,160.00	0.34
60	688120	华海清科	1,043	262,888.15	0.34
61	000733	振华科技	2,700	258,795.00	0.33
62	002429	兆驰股份	46,100	253,550.00	0.32
63	603345	安井食品	1,700	249,560.00	0.32
64	001696	宗申动力	33,700	238,596.00	0.31
65	600011	华能国际	25,400	235,204.00	0.30
66	600256	广汇能源	34,000	233,240.00	0.30
67	002027	分众传媒	34,200	232,902.00	0.30
68	601012	隆基绿能	8,100	232,227.00	0.30
69	002438	江苏神通	20,000	229,600.00	0.29
70	002129	TCL 中环	6,675	221,610.00	0.28
71	688063	派能科技	1,100	218,075.00	0.28
72	603156	养元饮品	8,800	217,360.00	0.28
73	300122	智飞生物	4,800	212,160.00	0.27
74	688559	海目星	4,500	211,545.00	0.27
75	688630	芯碁微装	2,500	210,050.00	0.27
76	600887	伊利股份	7,400	209,568.00	0.27
77	600642	申能股份	29,900	209,001.00	0.27
78	688126	沪硅产业	10,000	209,000.00	0.27
79	300036	超图软件	8,600	203,906.00	0.26
80	600060	海信视像	8,200	202,950.00	0.26
81	600057	厦门象屿	23,300	202,710.00	0.26
82	603369	今世缘	3,800	200,640.00	0.26
83	603456	九洲药业	7,300	199,874.00	0.26
84	600050	中国联通	41,300	198,240.00	0.25
85	002223	鱼跃医疗	5,500	197,945.00	0.25
86	002017	东信和平	14,930	195,732.30	0.25
87	600612	老凤祥	2,800	195,664.00	0.25
88	003019	宸展光电	9,500	194,750.00	0.25
89	000100	TCL 科技	49,240	194,005.60	0.25
90	000301	东方盛虹	16,300	192,666.00	0.25
91	601222	林洋能源	23,400	191,646.00	0.25
92	002154	报喜鸟	34,500	190,440.00	0.24
93	002917	金奥博	15,400	190,344.00	0.24
94	600875	东方电气	10,200	190,230.00	0.24
95	301004	嘉益股份	4,900	190,120.00	0.24

96	002063	远光软件	21,900	190,092.00	0.24
97	603859	能科科技	3,700	189,181.00	0.24
98	002518	科士达	4,700	188,047.00	0.24
99	002056	横店东磁	10,300	187,563.00	0.24
100	002439	启明星辰	6,300	187,488.00	0.24
101	603551	奥普家居	14,500	187,485.00	0.24
102	000997	新大陆	9,900	187,110.00	0.24
103	603628	清源股份	11,800	186,794.00	0.24
104	603027	千禾味业	8,820	186,278.40	0.24
105	000913	钱江摩托	10,200	185,946.00	0.24
106	000338	潍柴动力	14,900	185,654.00	0.24
107	600438	通威股份	5,400	185,274.00	0.24
108	002912	中新赛克	4,200	184,842.00	0.24
109	600820	隧道股份	30,700	184,507.00	0.24
110	000739	普洛药业	10,400	184,496.00	0.24
111	605266	健之佳	2,200	184,426.00	0.24
112	300777	中简科技	3,900	184,314.00	0.24
113	600329	达仁堂	4,100	184,049.00	0.24
114	600583	海油工程	31,400	183,690.00	0.23
115	601567	三星医疗	14,500	183,135.00	0.23
116	603283	赛腾股份	4,100	182,450.00	0.23
117	300775	三角防务	5,400	182,412.00	0.23
118	605098	行动教育	4,600	182,114.00	0.23
119	688261	东微半导	1,300	181,831.00	0.23
120	000155	川能动力	12,600	181,440.00	0.23
121	002997	瑞鹄模具	6,100	181,353.00	0.23
122	601128	常熟银行	26,500	180,730.00	0.23
123	301268	铭利达	4,300	180,041.00	0.23
124	300633	开立医疗	3,300	179,850.00	0.23
125	300634	彩讯股份	6,800	179,520.00	0.23
126	688700	东威科技	1,800	179,514.00	0.23
127	300638	广和通	7,900	179,172.00	0.23
128	600537	亿晶光电	23,400	178,776.00	0.23
129	000425	徐工机械	26,400	178,728.00	0.23
130	688676	金盘科技	5,900	178,711.00	0.23
131	300511	雪榕生物	23,400	177,840.00	0.23
132	605009	豪悦护理	3,700	177,600.00	0.23
133	600985	淮北矿业	15,400	177,408.00	0.23
134	603383	顶点软件	3,200	177,344.00	0.23
135	600276	恒瑞医药	3,700	177,230.00	0.23
136	002727	一心堂	6,700	176,880.00	0.23
137	002739	万达电影	14,100	176,814.00	0.23
138	002230	科大讯飞	2,600	176,696.00	0.23

139	600285	羚锐制药	11,000	176,660.00	0.23
140	603878	武进不锈	20,900	176,605.00	0.23
141	600161	天坛生物	6,500	176,475.00	0.23
142	688401	路维光电	4,700	176,438.00	0.23
143	002033	丽江股份	16,200	176,256.00	0.23
143	601377	兴业证券	28,800	176,256.00	0.23
144	600582	天地科技	30,200	176,066.00	0.23
145	002459	晶澳科技	4,220	175,974.00	0.23
146	300130	新国都	6,200	175,646.00	0.22
147	002139	拓邦股份	13,400	174,870.00	0.22
148	300532	今天国际	8,500	174,760.00	0.22
149	000928	中钢国际	18,100	174,665.00	0.22
150	000625	长安汽车	13,500	174,555.00	0.22
151	601958	金钼股份	15,600	173,940.00	0.22
152	601618	中国中冶	43,800	173,886.00	0.22
153	603639	海利尔	9,700	173,824.00	0.22
154	002852	道道全	13,400	173,262.00	0.22
155	603323	苏农银行	41,100	173,031.00	0.22
156	605499	东鹏饮料	1,000	172,900.00	0.22
157	601225	陕西煤业	9,500	172,805.00	0.22
158	603290	斯达半导	800	172,160.00	0.22
159	600481	双良节能	12,300	171,954.00	0.22
160	300537	广信材料	10,500	171,570.00	0.22
161	688002	睿创微纳	3,827	171,449.60	0.22
162	002885	京泉华	7,840	171,225.60	0.22
163	600901	江苏金租	41,440	171,147.20	0.22
164	601000	唐山港	48,400	170,852.00	0.22
165	601717	郑煤机	13,700	170,565.00	0.22
166	300203	聚光科技	8,400	170,268.00	0.22
167	603757	大元泵业	5,700	170,088.00	0.22
168	600603	广汇物流	24,400	169,824.00	0.22
169	688516	奥特维	900	169,560.00	0.22
170	002603	以岭药业	6,600	169,554.00	0.22
171	603505	金石资源	7,260	169,521.00	0.22
172	002334	英威腾	13,300	169,442.00	0.22
173	603619	中曼石油	10,000	169,200.00	0.22
174	002373	千方科技	12,400	169,136.00	0.22
175	002131	利欧股份	73,500	169,050.00	0.22
176	002065	东华软件	23,900	168,734.00	0.22
177	300127	银河磁体	9,300	168,609.00	0.22
178	000589	贵州轮胎	30,100	168,560.00	0.22
179	300811	铂科新材	2,820	167,620.80	0.21
180	600096	云天化	9,800	167,286.00	0.21

181	002600	领益智造	24,200	167,222.00	0.21
182	600089	特变电工	7,500	167,175.00	0.21
183	600748	上实发展	42,300	167,085.00	0.21
184	300217	东方电热	28,500	167,010.00	0.21
185	002829	星网宇达	3,800	166,934.00	0.21
186	000906	浙商中拓	18,700	166,804.00	0.21
187	301039	中集车辆	12,600	166,698.00	0.21
188	002533	金杯电工	20,400	166,464.00	0.21
189	300674	宇信科技	9,400	166,192.00	0.21
190	601877	正泰电器	6,000	165,900.00	0.21
191	601003	柳钢股份	40,900	165,236.00	0.21
192	601163	三角轮胎	10,400	165,048.00	0.21
193	002249	大洋电机	28,900	164,730.00	0.21
194	001979	招商蛇口	12,600	164,178.00	0.21
195	000591	太阳能	24,100	163,398.00	0.21
196	000157	中联重科	24,200	163,350.00	0.21
197	600863	内蒙华电	39,300	163,095.00	0.21
198	600064	南京高科	24,500	161,945.00	0.21
199	002060	粤水电	24,600	161,868.00	0.21
200	600728	佳都科技	23,300	161,469.00	0.21
201	300224	正海磁材	12,500	160,750.00	0.21
202	603697	有友食品	17,500	160,475.00	0.21
203	600718	东软集团	15,000	159,900.00	0.20
204	600301	华锡有色	8,900	159,755.00	0.20
205	000534	万泽股份	9,500	159,315.00	0.20
206	000333	美的集团	2,700	159,084.00	0.20
207	600572	康恩贝	23,200	158,920.00	0.20
208	300848	美瑞新材	7,600	157,700.00	0.20
209	000629	钒钛股份	40,300	157,573.00	0.20
210	002424	贵州百灵	17,500	157,150.00	0.20
211	603338	浙江鼎力	2,800	156,828.00	0.20
212	002920	德赛西威	1,000	155,810.00	0.20
213	002541	鸿路钢构	5,400	155,574.00	0.20
214	002138	顺络电子	6,500	155,415.00	0.20
215	300232	洲明科技	17,000	155,380.00	0.20
216	002008	大族激光	5,900	154,580.00	0.20
217	300327	中颖电子	5,500	153,780.00	0.20
218	002003	伟星股份	16,400	153,504.00	0.20
219	002025	航天电器	2,400	153,120.00	0.20
220	000060	中金岭南	32,200	152,950.00	0.20
221	688030	山石网科	7,100	152,153.00	0.19
222	301029	怡合达	3,400	151,912.00	0.19
223	300383	光环新网	14,100	151,575.00	0.19

224	002625	光启技术	9,900	151,074.00	0.19
225	300661	圣邦股份	1,835	150,708.55	0.19
226	002488	金固股份	21,800	150,420.00	0.19
227	000877	天山股份	18,400	149,776.00	0.19
228	002020	京新药业	11,600	148,712.00	0.19
229	688019	安集科技	900	148,347.00	0.19
230	301367	怡和嘉业	1,000	148,340.00	0.19
231	002372	伟星新材	7,200	147,888.00	0.19
232	300376	易事特	22,000	147,400.00	0.19
233	002180	纳思达	4,300	147,275.00	0.19
234	002478	常宝股份	19,500	145,275.00	0.19
235	000932	华菱钢铁	30,200	144,054.00	0.18
236	603368	柳药集团	5,800	143,318.00	0.18
237	002555	三七互娱	4,100	143,008.00	0.18
238	601601	中国太保	5,500	142,890.00	0.18
239	003029	吉大正元	4,400	142,780.00	0.18
240	002458	益生股份	11,400	140,790.00	0.18
241	600085	同仁堂	2,400	138,144.00	0.18
242	600028	中国石化	21,400	136,104.00	0.17
243	300454	深信服	1,200	135,900.00	0.17
244	300763	锦浪科技	1,300	135,330.00	0.17
245	600398	海澜之家	19,400	133,472.00	0.17
246	300751	迈为股份	780	132,116.40	0.17
247	600845	宝信软件	2,580	131,089.80	0.17
248	600502	安徽建工	23,900	126,192.00	0.16
249	601898	中煤能源	14,900	125,756.00	0.16
250	601965	中国汽研	6,000	123,900.00	0.16
251	603529	爱玛科技	3,800	122,436.00	0.16
252	688066	航天宏图	2,000	121,800.00	0.16
253	600970	中材国际	9,500	121,125.00	0.15
254	600559	老白干酒	4,900	120,099.00	0.15
255	605117	德业股份	800	119,640.00	0.15
256	688116	天奈科技	2,600	118,950.00	0.15
257	600487	亨通光电	8,100	118,746.00	0.15
258	600547	山东黄金	5,000	117,400.00	0.15
259	601019	山东出版	12,800	117,376.00	0.15
260	000603	盛达资源	9,700	117,273.00	0.15
261	601615	明阳智能	6,900	116,472.00	0.15
262	601006	大秦铁路	15,600	115,908.00	0.15
263	002815	崇达技术	9,200	114,540.00	0.15
264	002128	电投能源	8,600	113,692.00	0.15
265	002283	天润工业	17,700	113,634.00	0.15
266	603589	口子窖	2,300	113,505.00	0.15

267	600025	华能水电	15,900	113,367.00	0.14
268	603306	华懋科技	3,900	113,178.00	0.14
269	688348	昱能科技	600	112,698.00	0.14
270	600536	中国软件	2,400	112,512.00	0.14
271	600478	科力远	15,700	112,098.00	0.14
272	600674	川投能源	7,400	111,370.00	0.14
273	603595	东尼电子	2,600	111,332.00	0.14
274	000761	本钢板材	27,700	110,800.00	0.14
275	002465	海格通信	10,700	110,638.00	0.14
276	601069	西部黄金	8,600	110,424.00	0.14
277	002583	海能达	19,000	110,390.00	0.14
278	000818	航锦科技	3,300	110,121.00	0.14
279	601998	中信银行	18,300	109,434.00	0.14
280	300691	联合光电	6,200	109,244.00	0.14
281	600967	内蒙一机	10,800	109,080.00	0.14
282	300014	亿纬锂能	1,800	108,900.00	0.14
283	600390	五矿资本	20,200	108,676.00	0.14
284	002396	星网锐捷	4,800	108,432.00	0.14
285	603609	禾丰股份	11,900	108,290.00	0.14
286	688425	铁建重工	22,500	108,225.00	0.14
287	600498	烽火通信	5,300	107,961.00	0.14
288	000567	海德股份	8,410	107,816.20	0.14
289	002925	盈趣科技	5,500	106,700.00	0.14
290	603579	荣泰健康	5,100	106,692.00	0.14
291	601211	国泰君安	7,600	106,324.00	0.14
292	002051	中工国际	8,900	106,177.00	0.14
293	000623	吉林敖东	6,600	105,864.00	0.14
294	002916	深南电路	1,400	105,518.00	0.13
295	300770	新媒股份	2,300	105,478.00	0.13
296	002544	普天科技	4,600	105,340.00	0.13
297	300033	同花顺	600	105,168.00	0.13
298	000688	国城矿业	6,900	104,673.00	0.13
299	600184	光电股份	7,900	103,727.00	0.13
300	300308	中际旭创	700	103,215.00	0.13
301	000800	一汽解放	12,300	102,951.00	0.13
302	002635	安洁科技	7,400	102,120.00	0.13
303	600446	金证股份	7,000	101,780.00	0.13
304	603018	华设集团	11,600	101,500.00	0.13
305	603392	万泰生物	1,520	101,490.40	0.13
306	603556	海兴电力	4,000	100,960.00	0.13
307	300134	大富科技	9,800	100,450.00	0.13
308	000028	国药一致	2,300	100,303.00	0.13
309	002841	视源股份	1,500	100,260.00	0.13

310	601869	长飞光纤	2,700	99,927.00	0.13
311	300059	东方财富	7,000	99,400.00	0.13
312	688561	奇安信	1,900	98,439.00	0.13
313	601369	陕鼓动力	10,800	98,388.00	0.13
314	603713	密尔克卫	1,100	97,999.00	0.13
315	688138	清溢光电	4,600	97,106.00	0.12
316	002006	精工科技	4,500	97,065.00	0.12
317	002653	海思科	4,100	96,760.00	0.12
318	688349	三一重能	3,000	96,660.00	0.12
319	300782	卓胜微	1,000	96,630.00	0.12
320	002987	京北方	4,400	96,448.00	0.12
321	300124	汇川技术	1,500	96,315.00	0.12
322	002270	华明装备	8,700	95,265.00	0.12
323	002237	恒邦股份	8,700	94,743.00	0.12
324	600779	水井坊	1,600	94,384.00	0.12
325	688777	中控技术	1,500	94,170.00	0.12
326	002150	通润装备	5,500	93,445.00	0.12
327	002236	大华股份	4,700	92,825.00	0.12
328	300672	国科微	1,100	91,685.00	0.12
329	300379	东方通	4,400	90,508.00	0.12
330	601168	西部矿业	8,500	89,335.00	0.11
331	688439	振华风光	800	87,856.00	0.11
332	688186	广大特材	2,700	87,831.00	0.11
333	300349	金卡智能	6,300	87,444.00	0.11
334	688536	思瑞浦	400	87,200.00	0.11
335	000058	深赛格	14,100	87,138.00	0.11
336	600588	用友网络	4,100	84,050.00	0.11
337	601598	中国外运	18,000	83,880.00	0.11
338	002649	博彦科技	5,800	81,954.00	0.10
339	002212	天融信	8,200	79,540.00	0.10
340	600637	东方明珠	10,100	78,982.00	0.10
341	002314	南山控股	23,900	78,870.00	0.10
342	300035	中科电气	6,500	78,130.00	0.10
343	300802	矩子科技	3,200	77,024.00	0.10
344	300682	朗新科技	3,300	76,824.00	0.10
345	002254	泰和新材	3,100	75,857.00	0.10
346	601028	玉龙股份	7,000	75,250.00	0.10
347	000596	古井贡酒	300	74,214.00	0.09
348	688183	生益电子	6,100	73,810.00	0.09
349	300613	富瀚微	1,300	73,762.00	0.09
350	688185	康希诺	900	73,350.00	0.09
351	603993	洛阳钼业	13,700	73,021.00	0.09
352	002446	盛路通信	7,700	72,765.00	0.09

353	688560	明冠新材	2,600	72,254.00	0.09
354	300687	赛意信息	2,600	72,228.00	0.09
355	002772	众兴菌业	6,300	71,190.00	0.09
356	300206	理邦仪器	4,700	70,876.00	0.09
357	601908	京运通	11,700	70,785.00	0.09
358	002938	鹏鼎控股	2,900	70,441.00	0.09
359	000951	中国重汽	4,100	69,085.00	0.09
360	600048	保利发展	5,300	69,059.00	0.09
361	600152	维科技术	7,400	68,672.00	0.09
362	002489	浙江永强	16,900	68,445.00	0.09
363	603339	四方科技	4,300	68,413.00	0.09
364	600535	天士力	4,700	68,197.00	0.09
365	688707	振华新材	2,200	67,738.00	0.09
366	000524	岭南控股	6,300	67,473.00	0.09
367	601939	建设银行	10,600	66,356.00	0.08
368	600066	宇通客车	4,500	66,330.00	0.08
369	600399	抚顺特钢	6,500	66,300.00	0.08
370	002335	科华数据	1,800	64,710.00	0.08
371	002651	利君股份	8,300	64,491.00	0.08
372	002540	亚太科技	11,000	63,580.00	0.08
373	601117	中国化学	7,600	62,928.00	0.08
374	688123	聚辰股份	1,100	59,092.00	0.08
375	603219	富佳股份	4,100	58,425.00	0.07
376	600195	中牧股份	5,000	58,400.00	0.07
377	300274	阳光电源	500	58,315.00	0.07
378	002085	万丰奥威	8,400	58,212.00	0.07
379	002142	宁波银行	2,300	58,190.00	0.07
380	300413	芒果超媒	1,700	58,157.00	0.07
381	002812	恩捷股份	600	57,810.00	0.07
381	300496	中科创达	600	57,810.00	0.07
382	600406	国电南瑞	2,500	57,750.00	0.07
383	603236	移远通信	1,000	57,710.00	0.07
384	688221	前沿生物	5,400	57,564.00	0.07
385	300525	博思软件	3,740	57,371.60	0.07
386	603515	欧普照明	2,800	56,840.00	0.07
387	603171	税友股份	1,400	55,972.00	0.07
388	300565	科信技术	3,300	55,506.00	0.07
389	688107	安路科技	1,000	55,390.00	0.07
390	300531	优博讯	3,900	55,146.00	0.07
391	300181	佐力药业	4,500	54,945.00	0.07
392	688235	百济神州	500	54,555.00	0.07
393	603212	赛伍技术	2,600	54,106.00	0.07
394	688578	艾力斯	2,000	53,900.00	0.07

395	600959	江苏有线	15,500	52,390.00	0.07
396	605339	南侨食品	2,600	51,766.00	0.07
397	688208	道通科技	1,700	51,527.00	0.07
398	600138	中青旅	4,100	51,291.00	0.07
399	300183	东软载波	3,100	51,181.00	0.07
400	300835	龙磁科技	1,600	50,208.00	0.06
401	600233	圆通速递	3,400	49,504.00	0.06
402	002549	凯美特气	4,300	49,450.00	0.06
403	603444	吉比特	100	49,111.00	0.06
404	688680	海优新材	400	48,728.00	0.06
405	300101	振芯科技	2,500	48,475.00	0.06
406	300465	高伟达	4,800	47,664.00	0.06
407	002294	信立泰	1,500	46,785.00	0.06
408	002415	海康威视	1,400	46,354.00	0.06
409	603203	快克智能	1,500	46,170.00	0.06
410	600132	重庆啤酒	500	46,080.00	0.06
411	603811	诚意药业	3,600	44,748.00	0.06
412	600989	宝丰能源	3,400	42,874.00	0.05
413	300316	晶盛机电	600	42,540.00	0.05
414	688007	光峰科技	2,000	41,700.00	0.05
415	603300	华铁应急	7,600	41,420.00	0.05
416	688369	致远互联	745	41,198.50	0.05
417	300593	新雷能	1,770	40,550.70	0.05
418	600419	天润乳业	2,500	40,550.00	0.05
419	300125	聆达股份	2,400	40,512.00	0.05
420	603303	得邦照明	2,900	40,049.00	0.05
421	003031	中瓷电子	300	39,936.00	0.05
422	688225	亚信安全	1,900	39,805.00	0.05
423	603348	文灿股份	900	39,429.00	0.05
424	688522	纳睿雷达	760	39,140.00	0.05
425	600185	格力地产	5,700	39,102.00	0.05
426	002860	星帅尔	2,900	39,092.00	0.05
427	688046	药康生物	2,000	38,780.00	0.05
428	601139	深圳燃气	5,300	38,637.00	0.05
429	688248	南网科技	1,000	38,390.00	0.05
430	000555	神州信息	3,100	38,130.00	0.05
431	603868	飞科电器	600	37,854.00	0.05
432	002152	广电运通	3,200	37,504.00	0.05
433	000708	中信特钢	2,300	36,432.00	0.05
434	603893	瑞芯微	500	36,425.00	0.05
435	600038	中直股份	900	35,838.00	0.05
436	300590	移为通信	2,900	35,438.00	0.05
437	600850	电科数字	1,500	35,385.00	0.05

438	603516	淳中科技	1,600	35,280.00	0.05
439	601872	招商轮船	6,000	34,740.00	0.04
440	002648	卫星化学	2,300	34,408.00	0.04
441	603931	格林达	1,100	33,495.00	0.04
442	603806	福斯特	900	33,471.00	0.04
443	603517	绝味食品	900	33,435.00	0.04
444	603612	索通发展	1,900	32,927.00	0.04
445	688786	悦安新材	700	32,473.00	0.04
446	300347	泰格医药	500	32,270.00	0.04
447	688677	海泰新光	560	31,774.40	0.04
448	300785	值得买	1,200	31,416.00	0.04
449	002405	四维图新	2,700	31,266.00	0.04
450	002430	杭氧股份	900	30,924.00	0.04
451	605377	华旺科技	1,700	30,685.00	0.04
452	000999	华润三九	500	30,330.00	0.04
453	600363	联创光电	800	29,680.00	0.04
454	600998	九州通	2,831	29,385.78	0.04
455	000528	柳工	3,700	29,230.00	0.04
456	601607	上海医药	1,300	29,133.00	0.04
457	603833	欧派家居	300	28,740.00	0.04
458	601928	凤凰传媒	2,500	28,500.00	0.04
459	688485	九州一轨	1,822	27,639.74	0.04
460	002895	川恒股份	1,400	27,580.00	0.04
461	002859	洁美科技	900	24,930.00	0.03
462	601611	中国核建	2,800	23,660.00	0.03
463	600000	浦发银行	3,200	23,168.00	0.03
464	600968	海油发展	7,500	23,025.00	0.03
465	000050	深天马 A	2,500	22,950.00	0.03
466	002947	恒铭达	1,100	22,924.00	0.03
467	002493	荣盛石化	1,900	22,116.00	0.03
468	300951	博硕科技	400	21,852.00	0.03
469	002979	雷赛智能	900	21,384.00	0.03
470	603379	三美股份	900	21,159.00	0.03
471	601628	中国人寿	600	20,976.00	0.03
472	002933	新兴装备	700	20,559.00	0.03
473	688180	君实生物	500	19,270.00	0.02
474	300567	精测电子	200	19,030.00	0.02
475	600941	中国移动	200	18,660.00	0.02
476	300869	康泰医学	800	18,368.00	0.02
477	688003	天准科技	400	17,852.00	0.02
478	600497	驰宏锌锗	3,300	16,566.00	0.02
479	001203	大中矿业	1,400	15,554.00	0.02
480	300735	光弘科技	1,400	14,980.00	0.02

481	601155	新城控股	1,000	14,410.00	0.02
482	600271	航天信息	1,000	13,690.00	0.02
483	605020	永和股份	520	13,421.20	0.02
484	002304	洋河股份	100	13,135.00	0.02
485	002975	博杰股份	300	13,092.00	0.02
486	605376	博迁新材	400	12,552.00	0.02
487	688508	芯朋微	200	11,598.00	0.01
488	300498	温氏股份	600	11,010.00	0.01
489	002271	东方雨虹	400	10,904.00	0.01
490	301026	浩通科技	300	10,716.00	0.01
491	000166	申万宏源	2,300	10,626.00	0.01
492	600198	大唐电信	1,400	9,590.00	0.01
493	002955	鸿合科技	400	9,420.00	0.01
494	688626	翔宇医疗	200	9,102.00	0.01
495	688298	东方生物	240	9,052.80	0.01
496	002966	苏州银行	1,300	8,515.00	0.01
497	603033	三维股份	400	8,140.00	0.01
498	300382	斯莱克	600	7,914.00	0.01
499	000651	格力电器	200	7,302.00	0.01
500	002011	盾安环境	500	6,915.00	0.01
501	002915	中欣氟材	400	6,684.00	0.01
502	002453	华软科技	600	6,414.00	0.01
503	000517	荣安地产	2,100	6,405.00	0.01
504	603170	宝立食品	300	6,378.00	0.01
505	688105	诺唯赞	200	6,098.00	0.01
506	300177	中海达	800	5,416.00	0.01
507	601137	博威合金	300	4,668.00	0.01
508	002929	润建股份	100	4,341.00	0.01
509	002443	金洲管道	600	3,996.00	0.01
510	002683	广东宏大	100	2,944.00	0.00
511	002244	滨江集团	300	2,646.00	0.00
512	300515	三德科技	100	1,612.00	0.00
513	300981	中红医疗	100	1,515.00	0.00
514	601098	中南传媒	100	1,160.00	0.00
515	603378	亚士创能	100	911.00	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	600519	贵州茅台	3,711,482.00	3.23
2	603290	斯达半导	3,334,668.00	2.91
3	603605	珀莱雅	3,281,489.00	2.86
4	002475	立讯精密	3,030,122.00	2.64

5	603688	石英股份	2,921,130.00	2.55
6	002027	分众传媒	2,910,243.00	2.54
7	600588	用友网络	2,884,447.00	2.51
8	002049	紫光国微	2,851,220.00	2.49
9	600258	首旅酒店	2,831,800.00	2.47
10	002410	广联达	2,806,937.40	2.45
11	605117	德业股份	2,700,744.00	2.35
12	300896	爱美客	2,633,595.00	2.30
13	600298	安琪酵母	2,611,498.00	2.28
14	600985	淮北矿业	2,591,825.00	2.26
15	601668	中国建筑	2,549,797.00	2.22
16	002594	比亚迪	2,516,181.00	2.19
17	600039	四川路桥	2,467,991.00	2.15
18	002304	洋河股份	2,463,631.00	2.15
19	000012	南玻 A	2,436,588.00	2.12
20	600750	江中药业	2,413,574.00	2.10
21	002179	中航光电	2,403,748.00	2.10
22	605499	东鹏饮料	2,371,669.00	2.07
23	002056	横店东磁	2,367,218.00	2.06
24	600809	山西汾酒	2,330,879.40	2.03
25	600732	爱旭股份	2,323,509.00	2.03
26	300009	安科生物	2,295,944.00	2.00

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	6,012,340.28	5.24
2	002049	紫光国微	5,082,847.00	4.43
3	603259	药明康德	4,995,213.00	4.35
4	600919	江苏银行	4,881,359.00	4.25
5	002594	比亚迪	4,785,395.00	4.17
6	600089	特变电工	4,444,609.00	3.87
7	000651	格力电器	3,976,287.00	3.47
8	600741	华域汽车	3,964,002.00	3.45
9	601668	中国建筑	3,944,316.00	3.44
10	601555	东吴证券	3,888,831.94	3.39
11	600837	海通证券	3,626,034.00	3.16
12	603369	今世缘	3,393,972.45	2.96
13	002179	中航光电	3,392,869.00	2.96
14	002304	洋河股份	3,353,156.00	2.92
15	603605	珀莱雅	3,174,483.80	2.77
16	600438	通威股份	3,171,533.00	2.76
17	603688	石英股份	3,141,953.00	2.74

18	300450	先导智能	3,132,172.00	2.73
19	000012	南玻 A	3,039,320.00	2.65
20	601318	中国平安	3,032,195.00	2.64
21	603290	斯达半导	2,901,717.00	2.53
22	605117	德业股份	2,877,655.40	2.51
23	600809	山西汾酒	2,854,849.00	2.49
24	601390	中国中铁	2,845,570.00	2.48
25	600588	用友网络	2,842,953.00	2.48
26	300009	安科生物	2,772,069.00	2.42
27	300861	美畅股份	2,720,516.66	2.37
28	002027	分众传媒	2,689,117.00	2.34
29	600570	恒生电子	2,669,887.00	2.33
30	002475	立讯精密	2,597,286.00	2.26
31	002074	国轩高科	2,572,467.00	2.24
32	600298	安琪酵母	2,551,614.00	2.22
33	600572	康恩贝	2,523,212.00	2.20
34	600009	上海机场	2,515,773.00	2.19
35	600702	舍得酒业	2,494,745.00	2.17
36	601688	华泰证券	2,454,172.00	2.14
37	601601	中国太保	2,428,329.74	2.12
38	600985	淮北矿业	2,393,776.00	2.09
39	002410	广联达	2,364,600.00	2.06
40	601009	南京银行	2,352,637.00	2.05
41	600750	江中药业	2,333,567.00	2.03
42	600256	广汇能源	2,323,929.00	2.03
43	600258	首旅酒店	2,320,872.00	2.02

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	525,358,162.84
卖出股票收入（成交）总额	558,728,183.39

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

本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他相关的衍生工具。本基金投资股指期货、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他相关的衍生工具。本基金投资股指期货、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

中国平安保险（集团）股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本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	22,679.02
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,053.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,732.96

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 (%)
2,716	22,793.76	2,868,637.04	4.63	59,039,227.71	95.37

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	99.99	0.000162

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

1. 本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
2. 本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年12月27日) 基金份额总额	1,252,624,403.22
本报告期期初基金份额总额	88,610,818.19

本报告期基金总申购份额	1,240,427.99
减：本报告期基金总赎回份额	27,943,381.43
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	61,907,864.75

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

			(%)		(%)	
长江证券股份有限公司	3	232,681,784.33	21.47	216,698.73	21.62	-
国泰君安证券股份有限公司	2	210,856,421.68	19.46	196,371.50	19.59	-
中信建投证券股份有限公司	3	130,117,208.90	12.01	121,179.35	12.09	-
东吴证券股份有限公司	2	90,257,119.00	8.33	84,057.23	8.39	-
摩根大通证券(中国)有限公司	1	72,807,129.41	6.72	67,805.62	6.77	-
华泰证券股份有限公司	2	61,790,645.44	5.70	57,546.65	5.74	-
华安证券股份有限公司	1	58,265,935.14	5.38	54,264.14	5.41	-
首创证券股份有限公司	2	40,491,662.04	3.74	37,709.72	3.76	-
江海证券股份有限公司	2	39,952,215.65	3.69	37,208.19	3.71	-
中信证券股份有限公司	3	34,637,831.36	3.20	25,330.70	2.53	-
广发证券股份有限公司	1	28,415,222.08	2.62	26,462.60	2.64	-
财通证券股份有限公司	1	25,162,215.50	2.32	23,434.10	2.34	-
太平洋证券股份有限公司	1	23,560,875.46	2.17	21,941.97	2.19	-
中泰证券股份有限公司	2	20,437,034.92	1.89	19,032.68	1.90	-

国海证券股份有限公司	2	14,092,436.44	1.30	13,124.46	1.31	本报告新增 2 个
信达证券股份有限公司	2	39,073.18	0.00	36.39	0.00	-
财信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	本报告新增 1 个
方正证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
华兴证券有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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 (%)
长江证券股份有限公司	14,667.36	14.17	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券(中国)有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
首创证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
江海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	88,870.45	85.83	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华兴证券有限公	-	-	-	-	-	-

司						
平安证券股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
五矿证券有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股 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新增济安财富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 1 月 12 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
3	景顺长城量化平衡灵活配置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系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 10 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 24 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 25 日
7	景顺长城量化平衡灵活配置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
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 8 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 18 日
11	景顺长城量化平衡灵活配置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
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 22 日
14	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
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 13 日
16	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证	中国证监会指定报刊及	2023 年 5 月 26 日

	券投资基金 2023 年第 1 号更新招募说明书	网站	
17	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 26 日
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 27 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 6 月 10 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 17 日
21	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
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 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101-20230507	21,956,135.70	596,432.32	22,552,568.02	0.00	0.00

产品特有风险

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

1、大额申购风险

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

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

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

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

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

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

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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件;
- 2、《景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
- 3、《景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
- 4、《景顺长城量化平衡灵活配置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