

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵
活配置混合型发起式证券投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	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	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	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	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 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51

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	51
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 市场中性策略执行情况	51
7.13 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合
基金主代码	008851
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 2 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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	64,497,544.53 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和绝对收益策略，有效对冲市场系统性风险，追求长期稳定的绝对收益。
投资策略	<p>本基金主要采用量化对冲的投资策略，一方面坚持采用基金管理人自主研发的量化模型构建股票投资组合，另一方面，灵活应用多种绝对收益策略有效对冲本基金的系统性风险，例如做空股指期货进行对冲操作，获取选股的超额收益，追求长期稳定的绝对收益。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金采用灵活配置的投资策略，根据基金所使用对冲工具的年化对冲成本来决定当月股票资产的投资比例，建仓期（6 个月）内不受仓位调整机制的约束，建仓期满的第一个月起（包括第一个月），如基金所使用对冲工具的年化对冲成本达到仓位调整阈值，则触发仓位调整机制。</p> <p>2、对冲策略</p> <p>本基金现阶段主要通过股指期货有效对冲持有股票的系统性风险。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理和风险控制的原则，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金通过对现货和期货市场相关性研究，计算需要的股指期货合约数量，并根据不同期货合约定价关系、保证金要求、流动性情况等因素，对股指期货合约数量及配比进行动态调整，寻求与现货资产的匹配，力争构建市场中性投资组合并获得稳定的正向超额收益。</p> <p>3、套利策略</p> <p>本基金寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉套利和绝对收益机会，以提高资本的利用率，从而达到投资策略的多元化，努力进一步提高绝对收益水平，例如股指期货套利、统计套利、定向增发套利、大宗交易套利、并购套利等。</p>
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期 1 年定期存款基准利率（税后）+1%。
风险收益特征	本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决

	于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。
--	-------------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	郭明
	联系电话	0755-82370388	(010) 66105799
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755-22381339	(010) 66105798
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		李进	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	634,361.38
本期利润	904,129.69
加权平均基金份额本期利润	0.0132
本期加权平均净值利润率	1.25%
本期基金份额净值增长率	1.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,976,134.23
期末可供分配基金份额利润	0.0616
期末基金资产净值	68,548,532.95
期末基金份额净值	1.0628
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	6.28%

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	0.15%	0.17%	0.19%	0.01%	-0.04%	0.16%
过去三个月	0.76%	0.20%	0.56%	0.01%	0.20%	0.19%
过去六个月	1.28%	0.26%	1.13%	0.01%	0.15%	0.25%
过去一年	3.25%	0.22%	2.31%	0.01%	0.94%	0.21%
过去三年	-0.59%	0.27%	7.26%	0.01%	-7.85%	0.26%
自基金合同生效起至今	6.28%	0.29%	10.85%	0.01%	-4.57%	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

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放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：基金的投资组合比例为：本基金权益类多头头寸的价值减去本基金权益类空头头寸的价值占

基金资产净值的 0-10%之间。本基金投资于同业存单和银行存款的合计占比不超过基金资产的 20%。在开放期的每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。在开放期，每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。本基金的建仓期为自 2020 年 2 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 2024 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 184 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	2020 年 2 月 27 日	-	21 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 21 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、《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金持有人谋求最大利益。本报告期内, 基金运作整体合法合规, 未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价, 同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 9 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

2024 年上半年，国内经济在经历了一季度的亮眼开局之后出现一定的边际走弱，较强的出口数据带动工业生产保持韧性，内需在地产持续下行、居民预期偏弱的背景下仍旧疲弱。从数据来看，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 50.4、49.5、49.5，5、6 两月 PMI 重新跌入收缩区间。今年前 6 个月工业增加值累计同比增长 6.0%，其中 6 月份工业增加值当月同比增长 5.3%，经济延续弱复苏的格局。6 月 CPI 同比上升 0.2%，环比下降 0.2%；PPI 同比下降 0.8%，环比下降 0.2%，价格类指标依旧偏弱。6 月 M2 同比增长 6.2%，M1 同比下降 5.0%，信贷需求仍然偏弱；6 月末外汇储备 3.22 万亿美元，汇率短期承压。整体而言，国内经济依然处于弱复苏的态势，“稳增长”政策的效果正在逐步显现。上半年 A 股市场震荡调整，结构有所分化，上证指数下跌 0.25%，沪深 300 指数上涨 0.89%，创业板指数下跌 10.99%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年上半年，本基金份额净值增长率为 1.28%，业绩比较基准收益率为 1.13%。

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 2024 年下半年，海外方面，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，我们认为三季度国内经济环比二季度大概率能够边际回升，前期政策的累积效应以及新的“稳增长”政策对经济形成一定支撑；新“国九条”的推出将会改善股市微观供需结构，并进一步提升 A 股市场的投资价值。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。股指期货方面，随着市场情绪改善，股指期货逐步改善，当基差收敛到合理范围内，我们将继续择机提升对冲仓位水平。展望未来，我们预计市场将持续保持热度，并且热点逐步开始轮换，这样的市场环境非常适合量化模型的表现，同时我们要警惕海外风险以及政策收紧带来的市场风险。

本基金主要采用量化对冲的投资策略，一方面坚持采用基金管理人自主研发的量化模型构建股票投资组合，另一方面，灵活应用多种绝对收益策略有效对冲本基金的系统性风险，获取选股的超额收益，追求长期稳定的绝对收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等

方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

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

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

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	4,166,953.14	1,591,558.13
结算备付金		8,367,997.03	6,537,369.88
存出保证金		5,780,014.82	7,118,251.45
交易性金融资产	6.4.7.2	50,429,232.64	62,020,737.71
其中：股票投资		50,429,232.64	62,020,737.71
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		-	11,717.30
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		68,744,197.63	77,279,634.47
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		0.01	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		67,372.39	78,951.47
应付托管费		11,228.73	13,158.56
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		17,820.62	67,927.00
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	99,242.93	150,144.50
负债合计		195,664.68	310,181.53
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	64,497,544.53	73,339,234.79
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	4,050,988.42	3,630,218.15
净资产合计		68,548,532.95	76,969,452.94
负债和净资产总计		68,744,197.63	77,279,634.47

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.0628 元，基金份额总额 64,497,544.53 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		1,492,963.06	5,325,018.23
1. 利息收入		76,535.32	172,013.59
其中：存款利息收入	6.4.7.13	76,535.32	172,013.59
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,144,692.94	6,982,903.04
其中：股票投资收益	6.4.7.14	421,550.96	12,169,672.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	89,977.10
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	40,180.13	-6,791,909.64
股利收益	6.4.7.19	682,961.85	1,515,163.37
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	271,677.67	-1,950,080.02
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	57.13	120,181.62
减：二、营业总支出		588,833.37	1,703,855.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	430,697.48	1,415,936.65
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	71,782.90	188,791.57
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		6,668.06	9,708.56
8. 其他费用	6.4.7.23	79,684.93	89,418.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		904,129.69	3,621,162.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		904,129.69	3,621,162.84
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		904,129.69	3,621,162.84

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	73,339,234.79	-	3,630,218.15	76,969,452.94
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	73,339,234.79	-	3,630,218.15	76,969,452.94
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-8,841,690.26	-	420,770.27	-8,420,919.99
(一)、综合收益总额	-	-	904,129.69	904,129.69
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-8,841,690.26	-	-483,359.42	-9,325,049.68
其中：1. 基金申购款	110,285.35	-	6,339.20	116,624.55
2. 基金赎回款	-8,951,975.61	-	-489,698.62	-9,441,674.23
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	64,497,544.53	-	4,050,988.42	68,548,532.95
项目	上年度可比期间 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	232,255,358.46	-	4,845,751.86	237,101,110.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	232,255,358.46	-	4,845,751.86	237,101,110.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	22,366,922.76	-	2,638,501.83	25,005,424.59
(一)、综合收益总额	-	-	3,621,162.84	3,621,162.84
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	22,366,922.76	-	-982,661.01	21,384,261.75
其中：1. 基金申购款	145,724,814.22	-	2,425,968.57	148,150,782.79
2. 基金赎回款	-123,357,891.46	-	-3,408,629.58	-126,766,521.04
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	254,622,281.22	-	7,484,253.69	262,106,534.91

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

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金(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[2019]2891号《关于准予景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式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《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式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2,803,173,163.28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0106号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2020年2月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,803,947,219.94份基金份额,其中认购资金利息折合774,056.66份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许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、政府支持机构债、政府支持债券、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、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、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资融券业务交易。本基金的投资组合比例为:本基金权益类多头头寸的价值减去本基金权益类空头头寸的价值占基金资产净值的0-10%之间。其中:权益类多头头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。权益类空头头寸价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值。本基金投资于同业存单和银行存款的合计占比不超过基金资产的20%。开放期内每个交易日日终,本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,封闭

期内每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。开放期每个交易日日终，在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。在封闭期内，本基金不受前述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期 1 年定期存款基准利率（税后）+1%。

本基金以定期开放的方式运作。本基金每三个月开放一次，每次开放期不超过 5 个工作日，每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份在后续每三个日历月中最后一个日历月，每个开放期的首日为当月沪深 300 股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购、赎回与转换业务，且不上市交易。

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 2024 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》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 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 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》、财税[2023]39 号《关于减半征收交易印花税的公告》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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	4,166,953.14
等于：本金	4,166,245.13
加：应计利息	708.01
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	4,166,953.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	52,591,753.82	-	50,429,232.64	-2,162,521.18
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	52,591,753.82	-	50,429,232.64	-2,162,521.18

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	-
货币衍生 工具	-	-	-	-
权益衍生 工具	-49,737,500.00	-	-	-
其中：股 指期货 投资	-49,737,500.00	-	-	-
其他衍生 工具	-	-	-	-
合计	-49,737,500.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2407	IC2407	-32.00	-31,472,640.00	1,731,320.00
IF2408	IF2408	-16.00	-16,451,520.00	82,020.00
合计				1,813,340.00
减：可抵销期货				1,813,340.00

暂收款				
净额				-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

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

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	19,679.81
其中：交易所市场	19,679.81
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,563.12
合计	99,242.93

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	73,339,234.79	73,339,234.79
本期申购	110,285.35	110,285.35
本期赎回（以“-”号填列）	-8,951,975.61	-8,951,975.61
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	64,497,544.53	64,497,544.53

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	3,641,600.85	-11,382.70	3,630,218.15
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	3,641,600.85	-11,382.70	3,630,218.15
本期利润	634,361.38	269,768.31	904,129.69
本期基金份额交易产生的变动数	-299,828.00	-183,531.42	-483,359.42
其中：基金申购款	4,113.16	2,226.04	6,339.20
基金赎回款	-303,941.16	-185,757.46	-489,698.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,976,134.23	74,854.19	4,050,988.42

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		17,951.68
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		58,245.81
其他		337.83
合计		76,535.32

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		421,550.96
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		421,550.96

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		241,216,563.27
减：卖出股票成本总额		240,598,738.04
减：交易费用		196,274.27
买卖股票差价收入		421,550.96

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

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	40,180.13

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	682,961.85
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	682,961.85

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,188,885.02
股票投资	-2,188,885.02
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	2,476,473.95
权证投资	-
期货投资	2,476,473.95
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	15,911.26
合计	271,677.67

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	57.13
合计	57.13

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	120.00
存托服务费	1.81
合计	79,684.93

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

本基金本报告期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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	430,697.48	1,415,936.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	164,044.06	320,557.11
应支付基金管理人的净管理费	266,653.42	1,095,379.54

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

根据《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》，自 2023 年 8 月 22 日起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X1.2%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	71,782.90	188,791.57

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X0.20%/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未与关联方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未与关联方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

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
基金合同生效日（2020年2月27日）持有的基金份额	10,001,000.10	10,001,000.10
报告期初持有的基金份额	10,001,000.10	10,001,000.10
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,000.10	10,001,000.10
报告期末持有的基金份额	15.5100%	3.9300%

占基金总份额比例		
----------	--	--

注：比例实际为保留两位小数。

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中国工商银行-活期	4,166,953.14	17,951.68	27,234,812.13	30,559.09

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，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

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

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金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 2024 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 2024 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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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							
货币资金	4,166,953.14	-	-	-	-	-	4,166,953.14
结算备付金	8,367,997.03	-	-	-	-	-	8,367,997.03
存出保证金	29,115.62	-	-	-	-	5,750,899.20	5,780,014.82
交易性金融资产	-	-	-	-	-	50,429,232.64	50,429,232.64
资产总计	12,564,065.79	-	-	-	-	56,180,131.84	68,744,197.63
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	67,372.39	67,372.39
应付托管费	-	-	-	-	-	11,228.73	11,228.73
应付清算款	-	-	-	-	-	0.01	0.01
应交税费	-	-	-	-	-	17,820.62	17,820.62
其他负债	-	-	-	-	-	99,242.93	99,242.93
负债总计	-	-	-	-	-	195,664.68	195,664.68
利率敏感度缺口	12,564,065.79	-	-	-	-	-	-
上年度末 2023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							
货币资金	1,591,558.13	-	-	-	-	-	1,591,558.13
结算备付金	6,537,369.88	-	-	-	-	-	6,537,369.88
存出保证金	62,112.25	-	-	-	-	7,056,139.20	7,118,251.45
交易性金融资产	-	-	-	-	-	62,020,737.71	62,020,737.71
应收清算款	-	-	-	-	-	11,717.30	11,717.30
资产总计	8,191,040.26	-	-	-	-	69,088,594.21	77,279,634.47

负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	78,951.47	78,951.47
应付托管费	-	-	-	-	-	13,158.56	13,158.56
应交税费	-	-	-	-	-	67,927.00	67,927.00
其他负债	-	-	-	-	-	150,144.50	150,144.50
负债总计	-	-	-	-	-	310,181.53	310,181.53
利率敏感度缺口	8,191,040.26	-	-	-	-	-	-

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	50,429,232.64	73.57	62,020,737.71	80.58
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	50,429,232.64	73.57	62,020,737.71	80.58

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注：6.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货

投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	348,405.58	160,978.89
	沪深 300 指数下降 5%	-348,405.58	-160,978.89

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	50,429,232.64	61,580,912.26
第二层次	-	11,484.99
第三层次	-	428,340.46
合计	50,429,232.64	62,020,737.71

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

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	50,429,232.64	73.36
	其中：股票	50,429,232.64	73.36
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	12,534,950.17	18.23
8	其他各项资产	5,780,014.82	8.41
9	合计	68,744,197.63	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	351,254.00	0.51
B	采矿业	2,932,298.00	4.28
C	制造业	30,570,831.58	44.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,465,353.65	3.60
E	建筑业	440,413.00	0.64

F	批发和零售业	554,353.40	0.81
G	交通运输、仓储和邮政业	1,122,579.16	1.64
H	住宿和餐饮业	9,880.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,954,655.95	4.31
J	金融业	6,343,882.80	9.25
K	房地产业	390,994.00	0.57
L	租赁和商务服务业	330,465.00	0.48
M	科学研究和技术服务业	206,411.10	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	37,236.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	409,496.00	0.60
R	文化、体育和娱乐业	1,190,153.00	1.74
S	综合	118,976.00	0.17
	合计	50,429,232.64	73.57

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	600519	贵州茅台	500	733,695.00	1.07
2	601318	中国平安	14,300	591,448.00	0.86
3	300750	宁德时代	2,400	432,072.00	0.63
4	603501	韦尔股份	4,000	397,480.00	0.58
5	601058	赛轮轮胎	27,600	386,400.00	0.56
6	600096	云天化	19,500	378,690.00	0.55
7	300760	迈瑞医疗	1,300	378,183.00	0.55
8	300724	捷佳伟创	6,900	372,669.00	0.54
9	603160	汇顶科技	5,400	371,250.00	0.54
10	601198	东兴证券	45,700	363,772.00	0.53
11	002128	电投能源	17,100	360,810.00	0.53
12	300251	光线传媒	42,700	359,107.00	0.52
13	600177	雅戈尔	50,100	356,712.00	0.52
14	002001	新和成	17,660	339,072.00	0.49
15	002008	大族激光	16,300	339,040.00	0.49
16	600066	宇通客车	13,100	337,980.00	0.49
17	600143	金发科技	50,400	333,144.00	0.49
18	300207	欣旺达	21,800	330,706.00	0.48
19	300144	宋城演艺	41,100	330,033.00	0.48
20	000728	国元证券	52,700	319,362.00	0.47

21	688772	珠海冠宇	21,390	318,711.00	0.46
22	600985	淮北矿业	18,400	308,016.00	0.45
23	000027	深圳能源	40,900	298,570.00	0.44
24	600036	招商银行	8,600	294,034.00	0.43
25	000725	京东方 A	71,700	293,253.00	0.43
26	000887	中鼎股份	23,900	292,536.00	0.43
27	002138	顺络电子	10,500	288,330.00	0.42
28	000155	川能动力	26,600	286,482.00	0.42
29	601717	郑煤机	19,300	285,640.00	0.42
30	600901	江苏金租	55,500	280,275.00	0.41
31	600737	中粮糖业	29,000	278,110.00	0.41
32	601166	兴业银行	15,700	276,634.00	0.40
33	600582	天地科技	39,900	274,911.00	0.40
34	000630	铜陵有色	75,300	271,833.00	0.40
35	601328	交通银行	36,100	269,667.00	0.39
36	002557	洽洽食品	9,400	264,986.00	0.39
37	300502	新易盛	2,500	263,875.00	0.38
38	600642	申能股份	29,500	260,485.00	0.38
39	600900	长江电力	9,000	260,280.00	0.38
40	600887	伊利股份	10,000	258,400.00	0.38
41	000651	格力电器	6,586	258,302.92	0.38
42	002507	涪陵榨菜	20,800	254,800.00	0.37
43	601615	明阳智能	26,600	251,104.00	0.37
44	300394	天孚通信	2,800	247,576.00	0.36
45	002019	亿帆医药	20,000	247,200.00	0.36
46	000758	中色股份	47,700	242,316.00	0.35
47	002384	东山精密	11,700	242,190.00	0.35
48	603882	金域医学	8,700	236,553.00	0.35
49	300054	鼎龙股份	10,400	235,872.00	0.34
50	601108	财通证券	34,700	229,367.00	0.33
51	300002	神州泰岳	28,200	228,984.00	0.33
52	601665	齐鲁银行	46,400	227,824.00	0.33
53	002465	海格通信	21,700	224,812.00	0.33
54	601128	常熟银行	29,490	223,239.30	0.33
55	600529	山东药玻	8,800	222,992.00	0.33
56	688008	澜起科技	3,836	219,265.76	0.32
57	300373	扬杰科技	5,600	217,840.00	0.32
58	002152	广电运通	20,700	216,522.00	0.32
59	601077	渝农商行	43,000	215,860.00	0.31
60	002558	巨人网络	22,500	212,400.00	0.31
61	601231	环旭电子	13,200	211,860.00	0.31
62	002739	万达电影	17,500	211,575.00	0.31
63	601668	中国建筑	39,600	210,276.00	0.31

64	002185	华天科技	25,800	210,270.00	0.31
65	600862	中航高科	11,100	208,458.00	0.30
66	600566	济川药业	6,500	206,115.00	0.30
67	600050	中国联通	43,100	202,570.00	0.30
68	002594	比亚迪	800	200,200.00	0.29
69	601636	旗滨集团	31,000	199,950.00	0.29
70	300383	光环新网	23,600	199,420.00	0.29
71	002340	格林美	30,900	196,833.00	0.29
72	603606	东方电缆	4,000	195,240.00	0.28
73	000997	新大陆	14,000	194,740.00	0.28
74	688002	睿创微纳	6,900	192,993.00	0.28
75	688120	华海清科	1,000	189,580.00	0.28
76	002497	雅化集团	21,200	189,104.00	0.28
77	002223	鱼跃医疗	5,000	188,000.00	0.27
78	600030	中信证券	10,300	187,769.00	0.27
79	000333	美的集团	2,900	187,050.00	0.27
80	601601	中国太保	6,700	186,662.00	0.27
81	603317	天味食品	16,300	185,983.00	0.27
82	601233	桐昆股份	11,600	185,136.00	0.27
83	600867	通化东宝	22,100	184,977.00	0.27
84	601688	华泰证券	14,800	183,372.00	0.27
85	000858	五粮液	1,400	179,256.00	0.26
86	002195	岩山科技	71,400	179,214.00	0.26
87	300896	爱美客	1,040	178,984.00	0.26
88	000830	鲁西化工	15,400	178,486.00	0.26
89	601990	南京证券	22,500	172,800.00	0.25
90	002353	杰瑞股份	4,900	171,892.00	0.25
91	600489	中金黄金	11,200	165,760.00	0.24
92	601211	国泰君安	12,100	163,955.00	0.24
93	002410	广联达	17,100	163,818.00	0.24
94	600765	中航重机	8,000	163,200.00	0.24
95	600352	浙江龙盛	18,900	162,351.00	0.24
96	601816	京沪高铁	30,100	161,637.00	0.24
97	600348	华阳股份	16,200	161,352.00	0.24
98	600398	海澜之家	17,400	160,776.00	0.23
99	300357	我武生物	7,800	157,716.00	0.23
100	002415	海康威视	5,100	157,641.00	0.23
101	000738	航发控制	7,800	156,546.00	0.23
102	002487	大金重工	6,700	153,296.00	0.22
103	000683	远兴能源	22,100	152,711.00	0.22
104	002966	苏州银行	20,300	152,250.00	0.22
105	601216	君正集团	41,200	152,028.00	0.22
106	600150	中国船舶	3,700	150,627.00	0.22

107	600845	宝信软件	4,700	150,071.00	0.22
108	300003	乐普医疗	10,100	149,884.00	0.22
109	688188	柏楚电子	800	147,640.00	0.22
110	600584	长电科技	4,600	145,866.00	0.21
111	600060	海信视像	5,800	143,492.00	0.21
112	603658	安图生物	3,100	142,817.00	0.21
113	600329	达仁堂	4,400	142,516.00	0.21
114	300390	天华新能	8,200	140,876.00	0.21
115	688036	传音控股	1,840	140,833.60	0.21
116	002563	森马服饰	24,200	140,602.00	0.21
117	600521	华海药业	8,200	139,810.00	0.20
118	300866	安克创新	1,960	139,571.60	0.20
119	002738	中矿资源	5,200	139,360.00	0.20
120	601666	平煤股份	12,400	138,880.00	0.20
121	002706	良信股份	20,200	138,572.00	0.20
122	600848	上海临港	15,100	137,561.00	0.20
123	600886	国投电力	7,500	136,800.00	0.20
124	002472	双环传动	6,200	136,524.00	0.20
125	603816	顾家家居	4,200	135,618.00	0.20
126	600938	中国海油	4,100	135,300.00	0.20
127	603885	吉祥航空	12,300	135,177.00	0.20
128	002301	齐心集团	27,900	134,757.00	0.20
129	601939	建设银行	18,200	134,680.00	0.20
130	000636	风华高科	10,300	134,518.00	0.20
131	300073	当升科技	3,900	133,809.00	0.20
132	600663	陆家嘴	15,000	132,300.00	0.19
133	000878	云南铜业	10,600	132,076.00	0.19
134	300212	易华录	7,800	131,274.00	0.19
135	002683	广东宏大	6,500	130,845.00	0.19
136	002475	立讯精密	3,300	129,723.00	0.19
137	000568	泸州老窖	900	129,141.00	0.19
138	300001	特锐德	6,400	128,768.00	0.19
139	002429	兆驰股份	26,600	127,946.00	0.19
140	002120	韵达股份	16,500	127,710.00	0.19
141	600483	福能股份	10,900	127,094.00	0.19
142	000600	建投能源	20,000	126,000.00	0.18
143	688371	菲沃泰	12,420	124,696.80	0.18
144	002595	豪迈科技	3,200	122,144.00	0.18
145	000338	潍柴动力	7,500	121,800.00	0.18
146	600380	健康元	10,900	121,753.00	0.18
147	600893	航发动力	3,300	120,615.00	0.18
148	002727	一心堂	7,900	119,211.00	0.17
149	600673	东阳光	16,900	118,976.00	0.17

150	688234	天岳先进	2,530	118,707.60	0.17
151	601658	邮储银行	23,400	118,638.00	0.17
152	002056	横店东磁	9,500	118,465.00	0.17
153	600801	华新水泥	8,600	118,250.00	0.17
154	002179	中航光电	3,100	117,955.00	0.17
155	002027	分众传媒	19,300	116,958.00	0.17
156	600755	厦门国贸	16,300	116,871.00	0.17
157	600760	中航沈飞	2,900	116,290.00	0.17
158	601019	山东出版	9,800	115,836.00	0.17
159	600909	华安证券	27,200	114,512.00	0.17
160	600161	天坛生物	4,680	114,192.00	0.17
161	000960	锡业股份	7,200	111,528.00	0.16
162	000550	江铃汽车	5,100	110,721.00	0.16
163	601916	浙商银行	40,100	110,676.00	0.16
164	600011	华能国际	11,500	110,630.00	0.16
165	603589	口子窖	2,800	109,732.00	0.16
166	001872	招商港口	5,700	109,725.00	0.16
167	603826	坤彩科技	3,780	109,506.60	0.16
168	002153	石基信息	19,000	108,870.00	0.16
169	002670	国盛金控	12,800	108,416.00	0.16
170	002180	纳思达	4,100	108,322.00	0.16
171	002531	天顺风能	12,000	107,280.00	0.16
172	002237	恒邦股份	9,300	107,043.00	0.16
173	002158	汉钟精机	6,400	107,008.00	0.16
174	002850	科达利	1,400	106,932.00	0.16
175	600038	中直股份	2,600	106,886.00	0.16
176	000958	电投产融	29,200	106,872.00	0.16
177	600282	南钢股份	21,300	106,074.00	0.15
178	600309	万华化学	1,300	105,118.00	0.15
179	601168	西部矿业	5,800	104,110.00	0.15
180	600276	恒瑞医药	2,700	103,842.00	0.15
181	600598	北大荒	8,300	103,667.00	0.15
182	600549	厦门钨业	6,000	103,500.00	0.15
183	300244	迪安诊断	8,600	103,200.00	0.15
184	688349	三一重能	4,140	102,837.60	0.15
185	300638	广和通	6,000	102,600.00	0.15
186	000563	陕国投 A	37,300	102,575.00	0.15
187	688981	中芯国际	2,220	102,342.00	0.15
188	601838	成都银行	6,700	101,773.00	0.15
189	601006	大秦铁路	14,200	101,672.00	0.15
190	002064	华峰化学	14,100	101,097.00	0.15
191	600039	四川路桥	12,800	100,992.00	0.15
192	000063	中兴通讯	3,600	100,692.00	0.15

193	600926	杭州银行	7,700	100,485.00	0.15
194	300037	新宙邦	3,500	99,960.00	0.15
195	002831	裕同科技	3,900	99,801.00	0.15
196	688372	伟测科技	2,530	99,504.90	0.15
197	000703	恒逸石化	13,900	98,551.00	0.14
198	601899	紫金矿业	5,600	98,392.00	0.14
199	601958	金钼股份	9,400	97,854.00	0.14
200	600885	宏发股份	3,500	96,880.00	0.14
201	688516	奥特维	2,300	96,163.00	0.14
202	002371	北方华创	300	95,967.00	0.14
203	600511	国药股份	3,100	95,449.00	0.14
204	300529	健帆生物	3,500	95,235.00	0.14
205	603305	旭升集团	9,000	95,040.00	0.14
206	600219	南山铝业	24,800	94,488.00	0.14
207	601633	长城汽车	3,700	93,610.00	0.14
208	688114	华大智造	1,955	92,686.55	0.14
209	002517	恺英网络	9,700	92,635.00	0.14
210	600032	浙江新能	12,600	91,728.00	0.13
211	600660	福耀玻璃	1,900	91,010.00	0.13
212	600271	航天信息	12,300	90,528.00	0.13
213	002276	万马股份	12,400	88,908.00	0.13
214	603267	鸿远电子	2,600	88,660.00	0.13
215	000712	锦龙股份	11,800	88,500.00	0.13
216	000818	航锦科技	4,000	88,320.00	0.13
217	600517	国网英大	20,300	87,899.00	0.13
218	601877	正泰电器	4,600	87,676.00	0.13
219	002833	弘亚数控	4,800	87,552.00	0.13
220	300130	新国都	5,200	86,528.00	0.13
221	002635	安洁科技	5,600	86,464.00	0.13
222	600941	中国移动	800	86,000.00	0.13
223	600956	新天绿能	10,300	84,151.00	0.12
224	300285	国瓷材料	4,700	83,895.00	0.12
225	600704	物产中大	19,300	83,762.00	0.12
226	688475	萤石网络	2,415	82,375.65	0.12
227	601127	赛力斯	900	82,008.00	0.12
228	002444	巨星科技	3,300	81,510.00	0.12
229	603185	弘元绿能	4,700	80,323.00	0.12
230	300366	创意信息	11,000	79,640.00	0.12
231	300498	温氏股份	4,000	79,280.00	0.12
232	600546	山煤国际	5,400	78,948.00	0.12
233	300408	三环集团	2,700	78,813.00	0.11
234	600919	江苏银行	10,600	78,758.00	0.11
235	000039	中集集团	8,500	78,710.00	0.11

236	601118	海南橡胶	17,200	78,260.00	0.11
237	300433	蓝思科技	4,282	78,146.50	0.11
238	002540	亚太科技	14,700	77,763.00	0.11
239	688220	翱捷科技	2,070	77,542.20	0.11
240	600019	宝钢股份	11,600	77,140.00	0.11
241	300872	天阳科技	5,800	76,850.00	0.11
242	688063	派能科技	1,932	76,719.72	0.11
243	002422	科伦药业	2,500	75,825.00	0.11
244	600025	华能水电	7,000	75,460.00	0.11
245	601225	陕西煤业	2,900	74,733.00	0.11
246	600000	浦发银行	9,000	74,070.00	0.11
247	002028	思源电气	1,100	73,590.00	0.11
248	600705	中航产融	32,600	72,372.00	0.11
249	300772	运达股份	7,500	72,000.00	0.11
250	300379	东方通	8,900	71,912.00	0.10
251	002352	顺丰控股	2,000	71,380.00	0.10
252	600988	赤峰黄金	4,300	70,262.00	0.10
253	000612	焦作万方	10,800	70,200.00	0.10
254	300017	网宿科技	8,800	69,520.00	0.10
255	600674	川投能源	3,700	69,375.00	0.10
256	300363	博腾股份	5,800	69,310.00	0.10
257	600435	北方导航	8,000	68,960.00	0.10
258	301238	瑞泰新材	4,600	68,862.00	0.10
259	601966	玲珑轮胎	3,700	67,969.00	0.10
260	601229	上海银行	9,300	67,518.00	0.10
261	000408	藏格矿业	2,800	67,396.00	0.10
262	300122	智飞生物	2,400	67,272.00	0.10
263	002791	坚朗五金	2,600	67,262.00	0.10
264	688180	君实生物	2,300	66,815.00	0.10
265	002241	歌尔股份	3,400	66,334.00	0.10
266	600395	盘江股份	11,000	66,110.00	0.10
267	300850	新强联	4,400	66,088.00	0.10
268	002299	圣农发展	4,800	65,472.00	0.10
269	688012	中微公司	459	64,838.34	0.09
270	603132	金徽股份	4,700	64,672.00	0.09
271	600916	中国黄金	6,700	64,454.00	0.09
272	000537	中绿电	6,700	63,851.00	0.09
273	600498	烽火通信	4,000	63,600.00	0.09
274	601858	中国科传	3,300	63,096.00	0.09
275	601336	新华保险	2,100	63,063.00	0.09
276	002192	融捷股份	2,100	63,042.00	0.09
277	603368	柳药集团	3,600	63,000.00	0.09
278	600585	海螺水泥	2,600	61,334.00	0.09

279	300751	迈为股份	500	59,740.00	0.09
280	603456	九洲药业	4,300	58,996.00	0.09
281	688550	瑞联新材	2,541	58,925.79	0.09
282	000598	兴蓉环境	7,800	58,656.00	0.09
283	002123	梦网科技	8,300	58,349.00	0.09
284	603985	恒润股份	4,800	57,120.00	0.08
285	300015	爱尔眼科	5,500	56,760.00	0.08
285	600690	海尔智家	2,000	56,760.00	0.08
286	002430	杭氧股份	2,500	55,625.00	0.08
287	600299	安迪苏	5,700	55,290.00	0.08
288	605090	九丰能源	1,900	55,100.00	0.08
289	000661	长春高新	600	55,062.00	0.08
290	688800	瑞可达	1,955	54,896.40	0.08
291	300114	中航电测	1,200	54,300.00	0.08
292	300832	新产业	800	53,952.00	0.08
293	002948	青岛银行	15,500	52,235.00	0.08
294	600933	爱柯迪	3,500	51,765.00	0.08
295	603259	药明康德	1,300	50,947.00	0.07
296	601021	春秋航空	900	50,697.00	0.07
297	002100	天康生物	7,300	50,589.00	0.07
298	600366	宁波韵升	9,600	50,112.00	0.07
299	002262	恩华药业	2,100	49,854.00	0.07
300	300274	阳光电源	800	49,624.00	0.07
301	300168	万达信息	10,400	49,400.00	0.07
302	600528	中铁工业	6,700	49,044.00	0.07
303	600699	均胜电子	3,300	48,906.00	0.07
304	601088	中国神华	1,100	48,807.00	0.07
305	603393	新天然气	1,400	48,636.00	0.07
306	688072	拓荆科技	400	48,044.00	0.07
307	601669	中国电建	8,500	47,515.00	0.07
308	603893	瑞芯微	800	47,336.00	0.07
309	000975	银泰黄金	2,900	47,241.00	0.07
310	688311	盟升电子	2,300	47,127.00	0.07
311	600372	中航机载	3,900	46,683.00	0.07
312	002142	宁波银行	2,100	46,326.00	0.07
313	600104	上汽集团	3,300	45,738.00	0.07
314	600563	法拉电子	600	45,708.00	0.07
315	601928	凤凰传媒	4,100	44,936.00	0.07
316	000166	申万宏源	10,300	44,393.00	0.06
317	300142	沃森生物	3,900	44,382.00	0.06
318	300226	上海钢联	2,600	44,044.00	0.06
319	600547	山东黄金	1,600	43,808.00	0.06
320	002106	莱宝高科	4,000	43,600.00	0.06

321	000923	河钢资源	2,500	43,050.00	0.06
322	300416	苏试试验	3,300	42,438.00	0.06
323	300595	欧普康视	2,700	42,336.00	0.06
324	603727	博迈科	3,200	42,112.00	0.06
325	601139	深圳燃气	6,200	41,416.00	0.06
326	600640	国脉文化	4,000	41,400.00	0.06
327	600925	苏能股份	8,100	40,905.00	0.06
328	600155	华创云信	6,900	40,779.00	0.06
329	600029	南方航空	6,900	40,641.00	0.06
330	603156	养元饮品	1,900	40,413.00	0.06
331	601628	中国人寿	1,300	40,365.00	0.06
332	600015	华夏银行	6,300	40,320.00	0.06
333	000050	深天马 A	5,500	40,040.00	0.06
334	601298	青岛港	4,036	38,584.16	0.06
335	603517	绝味食品	2,500	38,500.00	0.06
336	601818	光大银行	12,000	38,040.00	0.06
337	600346	恒力石化	2,700	37,665.00	0.05
338	002311	海大集团	800	37,640.00	0.05
339	000423	东阿阿胶	600	37,560.00	0.05
340	002048	宁波华翔	2,900	37,526.00	0.05
341	600967	内蒙一机	5,200	37,440.00	0.05
342	600970	中材国际	3,100	37,386.00	0.05
343	002318	久立特材	1,600	37,328.00	0.05
344	600426	华鲁恒升	1,400	37,296.00	0.05
345	003031	中瓷电子	800	36,992.00	0.05
346	603369	今世缘	800	36,960.00	0.05
347	600048	保利发展	4,200	36,792.00	0.05
348	605111	新洁能	1,180	36,096.20	0.05
349	600233	圆通速递	2,300	35,995.00	0.05
350	600158	中体产业	4,600	35,374.00	0.05
351	603123	翠微股份	5,800	34,452.00	0.05
352	002736	国信证券	3,900	33,891.00	0.05
353	600018	上港集团	5,800	33,524.00	0.05
354	600803	新奥股份	1,600	33,280.00	0.05
355	001965	招商公路	2,800	33,208.00	0.05
356	002332	仙琚制药	2,900	33,089.00	0.05
357	002690	美亚光电	2,000	33,000.00	0.05
358	601607	上海医药	1,700	32,487.00	0.05
359	000933	神火股份	1,600	32,368.00	0.05
360	603228	景旺电子	1,000	31,800.00	0.05
361	600522	中天科技	2,000	31,700.00	0.05
362	300085	银之杰	3,900	31,512.00	0.05
363	000778	新兴铸管	9,000	31,320.00	0.05

364	600415	小商品城	4,200	31,164.00	0.05
365	600873	梅花生物	3,100	31,062.00	0.05
366	688233	神工股份	1,610	31,024.70	0.05
367	002271	东方雨虹	2,500	30,850.00	0.05
368	000538	云南白药	600	30,690.00	0.04
369	002351	漫步者	2,300	30,245.00	0.04
370	601009	南京银行	2,900	30,131.00	0.04
371	600406	国电南瑞	1,200	29,952.00	0.04
372	688099	晶晨股份	500	29,660.00	0.04
373	600183	生益科技	1,400	29,484.00	0.04
374	600989	宝丰能源	1,700	29,461.00	0.04
375	600332	白云山	1,000	29,330.00	0.04
376	600399	抚顺特钢	5,200	29,276.00	0.04
377	000009	中国宝安	3,400	29,240.00	0.04
378	002423	中粮资本	3,900	29,211.00	0.04
379	688388	嘉元科技	2,990	29,152.50	0.04
380	300567	精测电子	500	28,255.00	0.04
381	000883	湖北能源	4,700	28,247.00	0.04
382	600298	安琪酵母	1,000	27,930.00	0.04
383	000567	海德股份	4,950	27,769.50	0.04
384	603806	福斯特	1,880	27,636.00	0.04
385	600008	首创环保	10,100	27,068.00	0.04
386	002252	上海莱士	3,400	26,588.00	0.04
387	600998	九州通	5,400	26,352.00	0.04
388	002354	天娱数科	8,700	26,013.00	0.04
389	300316	晶盛机电	900	25,857.00	0.04
390	002436	兴森科技	2,500	25,800.00	0.04
391	600004	白云机场	2,700	25,596.00	0.04
392	600968	海油发展	6,200	25,544.00	0.04
393	688276	百克生物	900	25,533.00	0.04
394	600548	深高速	2,400	25,512.00	0.04
395	300059	东方财富	2,400	25,344.00	0.04
396	600373	中文传媒	1,700	25,228.00	0.04
397	600377	宁沪高速	2,000	25,200.00	0.04
398	688207	格灵深瞳	2,185	25,061.95	0.04
399	603348	文灿股份	900	24,921.00	0.04
400	300699	光威复材	1,000	24,830.00	0.04
401	603568	伟明环保	1,200	24,696.00	0.04
402	000709	河钢股份	12,700	24,638.00	0.04
403	000998	隆平高科	2,500	24,575.00	0.04
404	601399	国机重装	9,500	24,510.00	0.04
405	002508	老板电器	1,100	24,310.00	0.04
406	600995	南网储能	2,500	24,150.00	0.04

407	002466	天齐锂业	800	23,928.00	0.03
408	002555	三七互娱	1,800	23,490.00	0.03
409	300296	利亚德	5,200	23,400.00	0.03
410	000987	越秀资本	4,700	23,312.00	0.03
411	601158	重庆水务	4,800	23,040.00	0.03
412	601608	中信重工	6,000	22,860.00	0.03
413	002240	盛新锂能	1,700	22,814.00	0.03
414	688065	凯赛生物	500	22,695.00	0.03
415	002156	通富微电	1,000	22,390.00	0.03
416	000559	万向钱潮	5,000	22,300.00	0.03
417	601117	中国化学	2,700	22,248.00	0.03
418	603605	珀莱雅	200	22,198.00	0.03
419	600603	广汇物流	4,400	22,176.00	0.03
420	001203	大中矿业	2,300	22,103.00	0.03
421	000967	盈峰环境	5,200	21,996.00	0.03
422	601228	广州港	7,200	21,960.00	0.03
423	603529	爱玛科技	800	21,864.00	0.03
424	300253	卫宁健康	3,700	21,830.00	0.03
425	600808	马钢股份	10,800	21,816.00	0.03
426	000002	万科 A	3,100	21,483.00	0.03
427	002572	索菲亚	1,400	21,462.00	0.03
428	688521	芯原股份	800	21,400.00	0.03
429	600315	上海家化	1,200	21,336.00	0.03
430	601985	中国核电	2,000	21,320.00	0.03
431	000596	古井贡酒	100	21,107.00	0.03
432	600809	山西汾酒	100	21,088.00	0.03
433	002215	诺普信	2,800	20,860.00	0.03
434	600126	杭钢股份	5,000	20,550.00	0.03
435	300124	汇川技术	400	20,520.00	0.03
436	600188	兖矿能源	900	20,457.00	0.03
437	002928	华夏航空	3,200	20,288.00	0.03
438	601919	中远海控	1,300	20,137.00	0.03
439	002155	湖南黄金	1,100	19,910.00	0.03
440	601169	北京银行	3,400	19,856.00	0.03
441	600016	民生银行	5,200	19,708.00	0.03
442	003029	吉大正元	1,100	19,569.00	0.03
443	300861	美畅股份	1,000	19,350.00	0.03
444	300308	中际旭创	140	19,303.20	0.03
445	600208	新潮中宝	12,100	19,118.00	0.03
446	603883	老百姓	1,040	19,094.40	0.03
447	688777	中控技术	500	18,850.00	0.03
448	688200	华峰测控	200	18,350.00	0.03
449	601456	国联证券	1,900	18,316.00	0.03

450	600839	四川长虹	4,000	17,960.00	0.03
451	603444	吉比特	100	17,801.00	0.03
452	600612	老凤祥	300	17,457.00	0.03
453	600820	隧道股份	2,500	16,325.00	0.02
454	601865	福莱特	800	16,080.00	0.02
455	001979	招商蛇口	1,700	14,943.00	0.02
456	002601	龙佰集团	800	14,856.00	0.02
457	300740	水羊股份	1,000	14,680.00	0.02
458	600600	青岛啤酒	200	14,554.00	0.02
459	600516	方大炭素	3,300	14,223.00	0.02
460	002236	大华股份	900	13,914.00	0.02
461	000963	华东医药	500	13,905.00	0.02
462	603195	公牛集团	180	13,881.60	0.02
463	688095	福昕软件	300	13,743.00	0.02
464	000030	富奥股份	2,600	12,766.00	0.02
465	600323	瀚蓝环境	600	12,540.00	0.02
466	601888	中国中免	200	12,498.00	0.02
467	300919	中伟股份	400	12,396.00	0.02
468	689009	九号公司	335	12,331.35	0.02
469	688029	南微医学	200	12,312.00	0.02
470	688123	聚辰股份	200	12,166.00	0.02
471	688025	杰普特	300	12,117.00	0.02
472	002938	鹏鼎控股	300	11,928.00	0.02
473	000895	双汇发展	500	11,885.00	0.02
474	603198	迎驾贡酒	200	11,500.00	0.02
475	000821	京山轻机	1,000	11,330.00	0.02
476	300284	苏交科	1,400	11,312.00	0.02
477	601000	唐山港	2,400	11,280.00	0.02
478	300973	立高食品	400	11,236.00	0.02
479	601881	中国银河	1,000	10,860.00	0.02
480	000503	国新健康	1,600	10,672.00	0.02
481	601377	兴业证券	2,100	10,626.00	0.02
482	603056	德邦股份	800	10,480.00	0.02
483	000517	荣安地产	3,900	10,452.00	0.02
484	300298	三诺生物	400	10,136.00	0.01
485	603730	岱美股份	1,000	9,940.00	0.01
486	600258	首旅酒店	800	9,880.00	0.01
487	688187	时代电气	200	9,876.00	0.01
488	002044	美年健康	2,500	9,450.00	0.01
489	300009	安科生物	1,100	9,394.00	0.01
490	301268	铭利达	600	9,330.00	0.01
491	601100	恒立液压	200	9,316.00	0.01
492	000983	山西焦煤	900	9,279.00	0.01

493	600153	建发股份	1,000	8,930.00	0.01
494	000729	燕京啤酒	1,000	8,830.00	0.01
495	600007	中国国贸	400	8,784.00	0.01
496	000066	中国长城	1,000	8,750.00	0.01
497	688601	力芯微	200	8,738.00	0.01
498	603330	天洋新材	1,800	8,622.00	0.01
499	300661	圣邦股份	100	8,278.00	0.01
500	300146	汤臣倍健	600	8,130.00	0.01
501	605589	圣泉集团	400	8,116.00	0.01
502	002304	洋河股份	100	8,074.00	0.01
503	300673	佩蒂股份	600	7,872.00	0.01
504	603328	依顿电子	1,000	7,860.00	0.01
505	002068	黑猫股份	1,100	7,810.00	0.01
506	300782	卓胜微	100	7,774.00	0.01
507	300559	佳发教育	800	7,656.00	0.01
508	002768	国恩股份	400	7,480.00	0.01
509	000513	丽珠集团	200	7,442.00	0.01
510	300482	万孚生物	300	7,320.00	0.01
511	002756	永兴材料	200	7,156.00	0.01
512	000792	盐湖股份	400	6,980.00	0.01
513	000157	中联重科	900	6,912.00	0.01
514	688439	振华风光	100	6,645.00	0.01
515	002821	凯莱英	100	6,580.00	0.01
516	000029	深深房 A	600	6,378.00	0.01
517	600795	国电电力	1,035	6,199.65	0.01
518	600497	驰宏锌锗	1,100	5,874.00	0.01
519	000999	华润三九	130	5,535.40	0.01
520	603296	华勤技术	100	5,523.00	0.01
521	603983	丸美股份	200	5,506.00	0.01
522	000625	长安汽车	400	5,372.00	0.01
523	002625	光启技术	300	5,205.00	0.01
524	300659	中孚信息	400	5,188.00	0.01
525	300841	康华生物	100	5,064.00	0.01
526	600028	中国石化	800	5,056.00	0.01
527	002032	苏泊尔	100	5,010.00	0.01
528	601098	中南传媒	400	4,968.00	0.01
529	688213	思特威	100	4,850.00	0.01
530	600636	国新文化	600	4,500.00	0.01
531	600459	贵研铂业	300	4,053.00	0.01
532	000937	冀中能源	600	4,020.00	0.01
533	688232	新点软件	200	3,944.00	0.01
534	603179	新泉股份	100	3,924.00	0.01
535	688100	威胜信息	100	3,815.00	0.01

536	300773	拉卡拉	300	3,729.00	0.01
537	688139	海尔生物	100	3,720.00	0.01
538	002088	鲁阳节能	300	3,627.00	0.01
539	601699	潞安环能	200	3,626.00	0.01
540	003000	劲仔食品	300	3,615.00	0.01
541	301239	普瑞眼科	100	3,533.00	0.01
542	603212	赛伍技术	300	3,312.00	0.00
543	002140	东华科技	400	3,100.00	0.00
544	000988	华工科技	100	2,993.00	0.00
545	688275	万润新能	100	2,942.00	0.00
546	688322	奥比中光	100	2,671.00	0.00
547	601186	中国铁建	300	2,571.00	0.00
548	600160	巨化股份	100	2,413.00	0.00
549	002955	鸿合科技	100	2,338.00	0.00
550	603690	至纯科技	100	2,301.00	0.00
551	688133	泰坦科技	140	2,209.20	0.00
552	300783	三只松鼠	100	2,187.00	0.00
553	600641	万业企业	184	2,162.00	0.00
554	002139	拓邦股份	200	2,124.00	0.00
555	300260	新莱应材	100	2,094.00	0.00
556	600764	中国海防	100	1,963.00	0.00
557	001338	永顺泰	200	1,960.00	0.00
558	688127	蓝特光学	100	1,839.00	0.00
559	688380	中微半导	100	1,672.00	0.00
560	600639	浦东金桥	100	1,021.00	0.00
561	002534	西子洁能	100	1,001.00	0.00
562	600958	东方证券	100	760.00	0.00
563	688221	前沿生物	100	555.00	0.00
564	688176	亚虹医药	100	511.00	0.00
565	003816	中国广核	100	463.00	0.00
566	000627	天茂集团	100	175.00	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	2,344,594.00	3.05
2	601318	中国平安	1,630,999.00	2.12
3	000333	美的集团	1,123,043.00	1.46
4	600089	特变电工	961,052.40	1.25
5	601899	紫金矿业	951,905.00	1.24
6	600309	万华化学	947,111.70	1.23
7	603160	汇顶科技	924,411.00	1.20

8	600030	中信证券	922,872.00	1.20
9	601717	郑煤机	913,120.00	1.19
10	002594	比亚迪	906,812.00	1.18
11	600919	江苏银行	885,479.00	1.15
12	603501	韦尔股份	845,997.00	1.10
13	300394	天孚通信	843,824.00	1.10
14	600737	中粮糖业	831,262.00	1.08
15	000651	格力电器	827,780.00	1.08
16	600887	伊利股份	823,361.00	1.07
17	300760	迈瑞医疗	790,400.00	1.03
18	000858	五粮液	789,334.00	1.03
19	600096	云天化	787,119.00	1.02
20	601688	华泰证券	779,567.00	1.01

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	4,061,288.00	5.28
2	601318	中国平安	1,678,270.00	2.18
3	000333	美的集团	1,302,733.00	1.69
4	300750	宁德时代	1,224,994.00	1.59
5	600900	长江电力	1,128,844.00	1.47
6	000651	格力电器	1,079,089.34	1.40
7	000568	泸州老窖	1,056,530.00	1.37
8	601919	中远海控	1,055,363.00	1.37
9	600887	伊利股份	1,043,731.00	1.36
10	601328	交通银行	1,043,551.00	1.36
11	601899	紫金矿业	1,027,849.00	1.34
12	600089	特变电工	994,555.00	1.29
13	000338	潍柴动力	968,082.00	1.26
14	600919	江苏银行	957,296.00	1.24
15	600309	万华化学	917,130.00	1.19
16	600030	中信证券	915,106.00	1.19
17	000858	五粮液	910,509.00	1.18
18	603259	药明康德	904,953.00	1.18
19	600036	招商银行	857,675.00	1.11
20	601939	建设银行	808,304.00	1.05

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	231,196,117.99
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	241,216,563.27
--------------	----------------

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

本基金现阶段主要通过股指期货有效对冲持有股票的系统性风险。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理和风险控制的原则，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金通过对现货和期货市场相关性研究，计算需要的股指期货合约数量，并根据不同期货合约定价关系、保证金要求、流动性情况等因素，对股指期货合约数量及配比进行动态调整，寻求与现货资产的匹配，力争构建市场中性投资组合并获得稳定的正向超额收益。

随着监管的放开及融资、融券等其他对冲工具的优势增强，本基金会优选空头工具，采用最优的多头系统性风险剥离方式。

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 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 50,429,232.64 元，占基金资产净值的比例为 73.57%；

运用股指期货进行对冲的空头合约市值-47,924,160.00 元，占基金资产净值的比例为-69.91%，空头合约市值占股票资产的比例为-95.03%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 461,731.09 元，公允价值变动损益为 271,677.67 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	5,780,014.82
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,780,014.82

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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 (%)
9,145	7,052.77	10,001,000.10	15.51	54,496,544.43	84.49

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	1,694.30	0.002627

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,000.10	15.51	10,000,000.00	0.36	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	不适用
基金经理等人员	-	-	-	-	不适用
基金管理人股东	-	-	-	-	不适用
其他	-	-	-	-	不适用
合计	10,001,000.10	15.51	10,000,000.00	0.36	-

注：发起份额总数为不包含利息的认购份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年2月27日）基金份额总额	2,803,947,219.94
本报告期期初基金份额总额	73,339,234.79
本报告期基金总申购份额	110,285.35
减：本报告期基金总赎回份额	8,951,975.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	64,497,544.53

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 (%)	
东方证券股份有限公司	3	472,412,681.26	100.00	45,302.86	100.00	未变更
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更

公司						
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
东亚前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
高盛(中国)证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
国都证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更

恒泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
华创证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	未变 更
华西证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
开源证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	未变 更
民生证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
平安证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	未变 更
瑞信证券 (中国)有 限公司	2	-	-	-	-	未变 更
瑞银证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	未变 更
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
太平洋证 券股份有 限公司	1	-	-	-	-	未变 更
天风证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
兴业证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
招商证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	未变 更
中国国际 金融股份 有限公司	2	-	-	-	-	未变 更
中国银河 证券股份	1	-	-	-	-	未变 更

有限公司						
中航证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中泰证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中信建投 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中信证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	未变更
中银国际 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中邮证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变更

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	成交金额	占当期债券 回购成交总	成交金额	占当期权证
		券				证

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
东方证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
长城证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
第一创 业证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东亚前 海证券 有限责 任公司	-	-	-	-	-	-
方正证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
高盛(中 国)证券 有限责 任公司	-	-	-	-	-	-
光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国都证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国海证 券股份 有限公	-	-	-	-	-	-

司						
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
国投证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
海通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华创证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
华西证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
开源证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
平安证 券股份 有限公	-	-	-	-	-	-

司						
瑞信证 券（中 国）有 限公 司	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券 有限公 司	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券股 份有限 公司	-	-	-	-	-	-
天风证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中航证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

司						
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中邮证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月10日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2023年第4季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月22日
3	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月22日
4	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于2024年2月2日至2024年2月8日第十六个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月31日
5	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于2024年2月2日至2024年2月8日第十六个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年2月1日
6	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于2024年2月2日至2024年2月8日第十六个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年2月2日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增长量基金为销售机构的	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月4日

	公告		
8	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	2024 年 3 月 22 日
9	关于警惕假冒景顺长城基金 APP 开展诈骗活动的声明	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 27 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日
11	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华福证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 10 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	2024 年 4 月 13 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	2024 年 4 月 15 日
15	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日
17	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2024 年 5 月 10 日至 2024 年 5 月 16 日第十七个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 7 日
18	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2024 年 5 月 10 日至 2024 年 5 月 16 日第十七个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 8 日
19	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2024 年 5 月 10 日至 2024 年 5 月 16 日第十七个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 9 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	2024 年 5 月 24 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	2024 年 5 月 31 日
22	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 14 日

23	景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 21 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 29 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

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日