

景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资
基金
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 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：2025 年 3 月 28 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。本年度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 2025 年 3 月 26 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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24

§ 8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
8.6 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	70
8.7 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	70
8.8 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	70
8.9 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	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	71
§ 9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
9.3 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	72
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	72
§ 10 开放式基金份额变动	72
§ 11 重大事件揭示	73
11.1 基金份额持有人大会决议	73
11.2 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	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	78
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	81
12.1 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	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§ 13 备查文件目录	81
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	81
13.3 查阅方式	81

§ 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	46,737,502.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	景顺长城量化平衡混合 A	景顺长城量化平衡混合 C
下属分级基金的交 易代码	005258	019215
报告期末下属分级 基金的份额总额	46,722,520.46 份	14,981.81 份

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	1、资产配置策略 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。 2、股票投资策略 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。 3、固定收益类投资策略 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。 4、股指期货、国债期货投资策略 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。 5、中小企业私募债券投资策略

	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。 6、资产支持证券投资策略 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，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	杨皞阳	张姗
	联系电话	0755-82370388	400-61-95555
	电子邮箱	investor@igwfm.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008888606	400-61-95555
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年		2023 年	2023 年 8 月 29 日 (C 类份额首个估值日)-2023 年 12 月 31 日	2022 年	
	景顺长城量化平衡混合 A	景顺长城量化平衡混合 C	景顺长城量化平衡混合 A	景顺长城量化平衡混合 C	景顺长城量化平衡混合 A	景顺长城量化平衡混合 C
本期已实现收益	-1,978,387.42	422.30	-12,823,135.06	-1,721.64	-27,163,873.24	-
本期利润	-174,611.63	1,025.77	-10,891,445.71	-1,188.48	-30,759,127.74	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0034	0.0471	-0.1578	-0.0704	-0.2939	-
本期加权平均净值利润率	-0.32%	4.40%	-12.60%	-6.22%	-21.00%	-
本期基金份额净值增长率	0.35%	-0.22%	-13.53%	-3.74%	-17.57%	-
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	5,768,274.88	1,733.81	6,685,068.39	2,366.94	26,121,720.80	-
期末可供分配基金份额利润	0.1235	0.1157	0.1196	0.1182	0.2948	-
期末基金资产净值	52,490,795.34	16,715.62	62,573,810.65	22,399.31	114,732,538.99	-
期末基金份额净值	1.1235	1.1157	1.1196	1.1182	1.2948	-
3.1.3 累计期	2024 年末		2023 年末		2022 年末	

末指标						
基金份额累计 净值增长率	12.35%	-3.95%	11.96%	-3.74%	29.48%	-

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，小数点后第五位四舍五入，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

景顺长城量化平衡混合 A

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
过去三个月	-2.82%	1.74%	-0.60%	1.07%	-2.22%	0.67%
过去六个月	6.98%	1.67%	9.10%	1.03%	-2.12%	0.64%
过去一年	0.35%	1.48%	8.43%	0.86%	-8.08%	0.62%
过去三年	-28.47%	1.18%	-10.41%	0.72%	-18.06%	0.46%
过去五年	12.47%	1.15%	4.58%	0.74%	7.89%	0.41%
自基金合同生效 起至今	12.35%	1.09%	4.87%	0.75%	7.48%	0.34%

景顺长城量化平衡混合 C

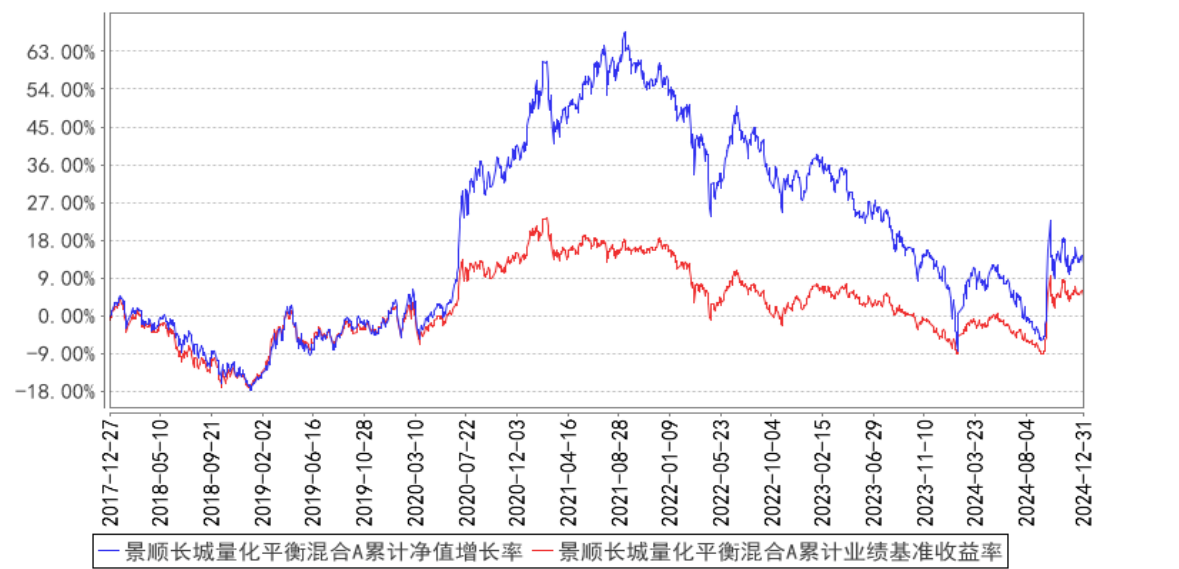
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.97%	1.73%	-0.60%	1.07%	-2.37%	0.66%
过去六个月	6.65%	1.67%	9.10%	1.03%	-2.45%	0.64%
过去一年	-0.22%	1.48%	8.43%	0.86%	-8.65%	0.62%

自基金合同生效 起至今	-3.95%	1.34%	3.85%	0.78%	-7.80%	0.56%
----------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

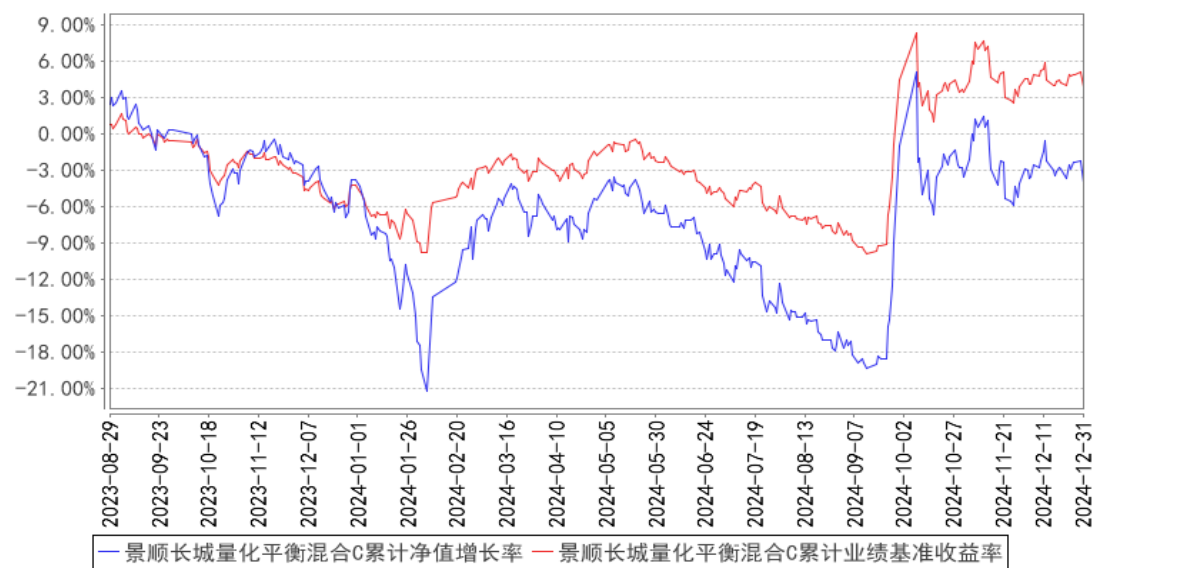
注：本基金于 2023 年 08 月 28 日增设 C 类基金份额，并于 2023 年 08 月 29 日开始对 C 类份额进行估值。

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A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城量化平衡混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

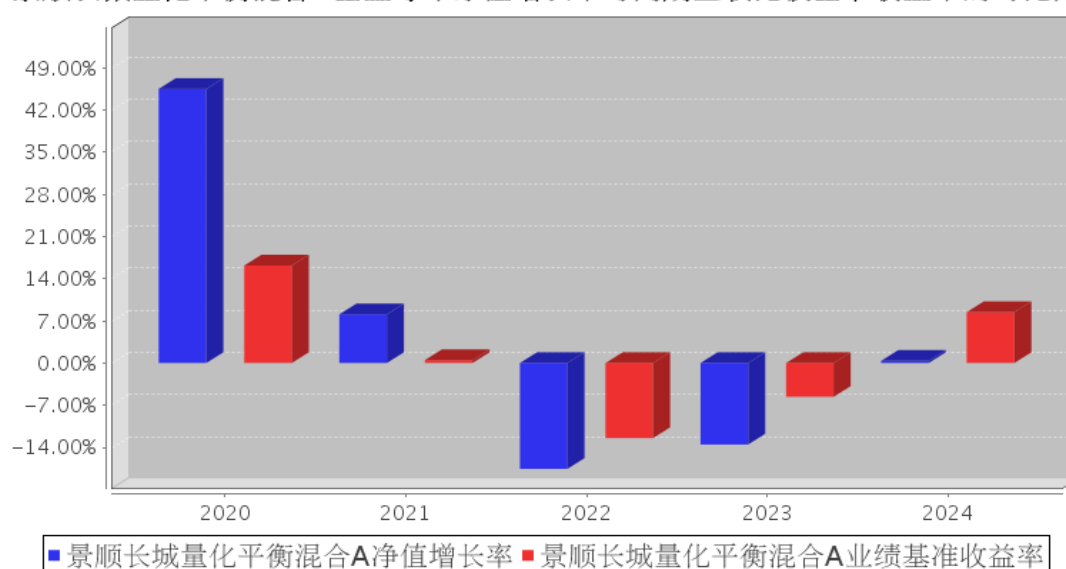


注：本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。权证、股指

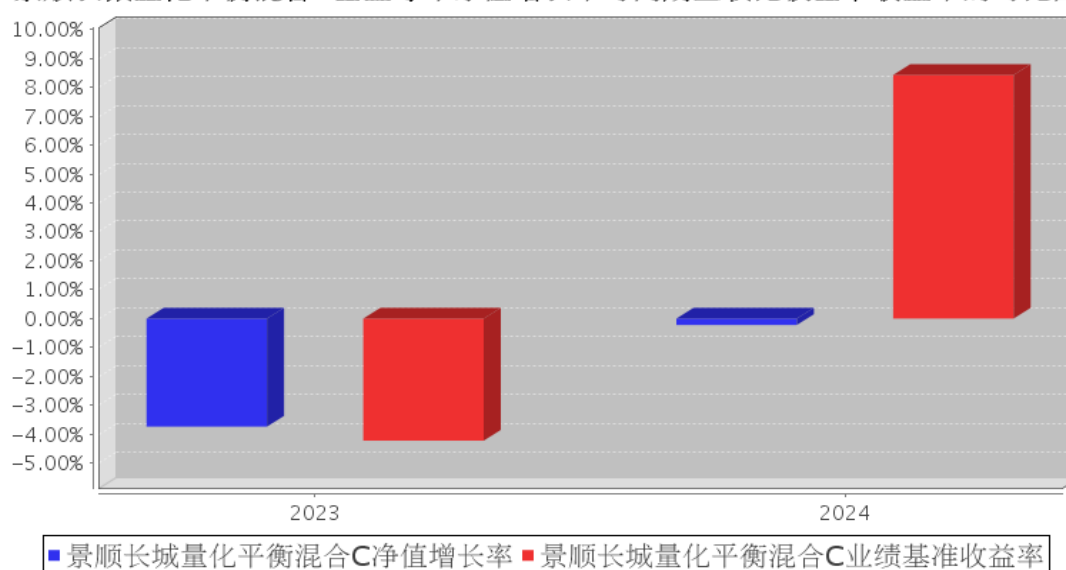
期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自 2017 年 12 月 27 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。本基金自 2023 年 8 月 28 日起增设 C 类基金份额。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城量化平衡混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



景顺长城量化平衡混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2023 年景顺长城量化平衡混合 C 类净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2023 年 08 月 29 日（C 类份额首个估值日）至 2023 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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12月31日，本公司旗下共管理191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		
徐喻军	本基金的基金经理	2017年12月27日	-	14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14年证券、基金行业从业经验。
黎海威	本基金的基金经理	2017年12月27日	2024年11月25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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内, 本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理, 严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定, 根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规, 本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》, 该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动, 同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下:

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度, 明确各投资决策主体的职责和权限划分; 建立客观的研究方法, 任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持, 避免主观臆断, 严禁利用内幕信息作为投资依据; 确保所有投资组合平等地享有研究成果; 根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等, 建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库, 投资组合经理在此基础上根据

投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 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投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 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 26 次，均为指数量化投资组合因投资策略

需要而发生的同日反向交易。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2024 年，全年经济运行呈现“前高、中低、后扬”的走势，9 月份以来，存量和增量政策精准发力，四季度经济明显回升。从数据来看，2024 年全年 GDP 增长 5.0%，其中四季度 GDP 当季同比增长 5.4%，显示出我国第四季度的刺激政策取得了显著成效。2024 年 10 月至 12 月国内制造业 PMI 依次为 50.1、50.3、50.1，连续三个月处于扩张区间，2025 年 1 月 PMI 有所回落，显示出新的增量政策依然有一定必要性。2025 年 1 月 CPI 同比上涨 0.50%，环比上涨 0.70%，价格水平持续改善。2024 年 12 月 M2 同比增长 7.3%，M1 同比下降 1.4%，M1 环比持续回升。从资产价格的表现来看，2024 年 A 股市场波动加剧，大盘风格显著优于小盘风格，价值风格优于成长风格，沪深 300、中证 500 和中证 1000 指数全年分别上涨 14.68%、5.46%和 1.2%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，景顺长城量化平衡混合 A 份额净值增长率为 0.35%，业绩比较基准收益率为 8.43%。

本报告期内，景顺长城量化平衡混合 C 份额净值增长率为-0.22%，业绩比较基准收益率为 8.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，宏观经济层面，海外市场的冲击依然存在，关税仍然是较大的不确定因素，但国内稳增长的政策方向已经逐步明朗，国内科技企业的快速崛起将系统性提升我国科技公司的估值水平，市场的机遇要大于风险。随着经济数据的不断验证以及市场风险偏好水平的逐步改善，权益类资产在低利率环境下的风险收益比将进一步凸显。在经济新旧动能转换的过程中，A 股市场仍然将以结构性机会为主，这将给我们的量化模型带来较大的发挥空间。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。

我们的组合仍主要以选股作为主要的收益来源，风格上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，同时也会积极捕捉困境反转类的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后继教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断

提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.8 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。

截至本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

4.9 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

从 2024 年 8 月 5 日至 2024 年 9 月 25 日，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

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遵规守信、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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70015711_H29 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相

	信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论

	认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	黄拥璇
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2025 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	3,189,329.85	3,910,930.05
结算备付金		235,592.31	1,350,437.48
存出保证金		6,166.51	6,911.56
交易性金融资产	7.4.7.2	49,315,462.24	57,844,901.49
其中：股票投资		49,315,462.24	57,838,901.04
基金投资		-	-
债券投资		-	6,000.45
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		168.21	2,194.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		52,746,719.12	63,115,375.07
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,087.89	149,858.19
应付管理人报酬		54,381.13	63,830.77
应付托管费		9,063.50	10,638.46
应付销售服务费		8.66	12.13
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	7.4.7.9	172,666.98	294,825.56
负债合计		239,208.16	519,165.11
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	46,737,502.27	55,908,774.63
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	5,770,008.69	6,687,435.33
净资产合计		52,507,510.96	62,596,209.96
负债和净资产总计		52,746,719.12	63,115,375.07

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 46,737,502.27 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.1235 元，基金份额 46,722,520.46 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.1157 元，基金份额 14,981.81 份。

7.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		733,461.85	-9,294,943.65
1. 利息收入		29,326.13	48,985.99

其中：存款利息收入	7.4.7.13	29,326.13	48,985.99
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）		-1,103,502.61	-11,331,134.25
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-2,171,654.96	-12,559,525.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	1,422.50	44,398.83
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	1,066,729.85	1,183,992.04
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）	7.4.7.20	1,804,379.26	1,932,222.51
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	3,259.07	54,982.10
减：二、营业总支出		907,047.71	1,597,690.54
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	657,091.93	1,235,151.59
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	109,515.29	205,858.64
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	141.70	39.41
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.03
8. 其他费用	7.4.7.23	140,298.79	156,640.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-173,585.86	-10,892,634.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-173,585.86	-10,892,634.19

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-173, 585. 86	-10, 892, 634. 19

7.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	55, 908, 774. 63	-	6, 687, 435. 33	62, 596, 209. 96
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	55, 908, 774. 63	-	6, 687, 435. 33	62, 596, 209. 96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9, 171, 272. 36	-	-917, 426. 64	-10, 088, 699. 00
（一）、综合收益总额	-	-	-173, 585. 86	-173, 585. 86
（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）	-9, 171, 272. 36	-	-743, 840. 78	-9, 915, 113. 14
其中：1. 基金申购款	1, 044, 227. 69	-	101, 941. 49	1, 146, 169. 18
2. 基金赎回款	-10, 215, 500. 05	-	-845, 782. 27	-11, 061, 282. 32
（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	46,737,502.27	-	5,770,008.69	52,507,510.96
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	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	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）	-32,702,043.56	-	-19,434,285.47	-52,136,329.03
（一）、综合收益总额	-	-	-10,892,634.19	-10,892,634.19
（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）	-32,702,043.56	-	-8,541,651.28	-41,243,694.84
其中：1. 基金申购款	2,670,374.21	-	641,317.80	3,311,692.01
2. 基金赎回款	-35,372,417.77	-	-9,182,969.08	-44,555,386.85
（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	55,908,774.63	-	6,687,435.33	62,596,209.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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。

根据法律法规的规定及《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《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》的约定，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，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 28 日起对景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费；C 类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

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 $\times$ 60%+一年期人民币定期存款利率（税后） $\times$ 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 2025 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 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、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 2 号《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。

7.4.3 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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金

融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期

间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）本基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于该类基金份额的面值，即基金收益分配基准日的某一类别的基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- （1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- （2）能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- （3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

（1）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征增值税试点的通知》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附加。

（2）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[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。

（3）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，（如有）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，（如有）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。

(4) 印花税（如适用）

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%，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、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	3,189,329.85	3,910,930.05
等于：本金	3,188,974.25	3,910,490.18
加：应计利息	355.60	439.87
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	-	-
存款期限 3 个月（含）至 1 年	-	-
存款期限 1 年（含）以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-

加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	3,189,329.85	3,910,930.05

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		48,491,229.20	-	49,315,462.24	824,233.04
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		48,491,229.20	-	49,315,462.24	824,233.04
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		58,819,047.26	-	57,838,901.04	-980,146.22
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	6,000.00	0.45	6,000.45	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,000.00	0.45	6,000.45	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		58,825,047.26	0.45	57,844,901.49	-980,146.22

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末的买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末的债权投资余额为零。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末的债权投资余额为零。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末的其他债权投资余额为零。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末的其他债权投资余额为零。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末的其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末的其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末的其他资产余额为零。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	3.19
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	63,366.98	170,822.37

其中：交易所市场	63,366.98	170,822.37
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	109,300.00	124,000.00
合计	172,666.98	294,825.56

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城量化平衡混合 A

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,888,742.26	55,888,742.26
本期申购	955,676.11	955,676.11
本期赎回（以“-”号填列）	-10,121,897.91	-10,121,897.91
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	46,722,520.46	46,722,520.46

景顺长城量化平衡混合 C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,032.37	20,032.37
本期申购	88,551.58	88,551.58
本期赎回（以“-”号填列）	-93,602.14	-93,602.14
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	14,981.81	14,981.81

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城量化平衡混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,236,749.21	-11,551,680.82	6,685,068.39
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	18,236,749.21	-11,551,680.82	6,685,068.39
本期利润	-1,978,387.42	1,803,775.79	-174,611.63
本期基金份额交易产生的变动数	-2,390,825.01	1,648,643.13	-742,181.88
其中：基金申购款	230,671.89	-136,097.63	94,574.26
基金赎回款	-2,621,496.90	1,784,740.76	-836,756.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,867,536.78	-8,099,261.90	5,768,274.88

景顺长城量化平衡混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,508.40	-4,141.46	2,366.94
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	6,508.40	-4,141.46	2,366.94
本期利润	422.30	603.47	1,025.77
本期基金份额交易产生的变动数	-2,597.59	938.69	-1,658.90
其中：基金申购款	20,139.64	-12,772.41	7,367.23
基金赎回款	-22,737.23	13,711.10	-9,026.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,333.11	-2,599.30	1,733.81

7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	12,882.31	24,301.18
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	16,351.18	24,388.84
其他	92.64	295.97
合计	29,326.13	48,985.99

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,171,654.96	-12,559,525.12

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	-2, 171, 654. 96	-12, 559, 525. 12

7.4.7.14.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总 额	354, 770, 971. 06	759, 062, 676. 60
减：卖出股票成本 总额	356, 194, 628. 33	769, 450, 739. 33
减：交易费用	747, 997. 69	2, 171, 462. 39
买卖股票差价收 入	-2, 171, 654. 96	-12, 559, 525. 12

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
债券投资收益——利 息收入	0. 50	21. 34
债券投资收益——买 卖债券（债转股及债 券到期兑付）差价收 入	1, 422. 00	44, 377. 49
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	1, 422. 50	44, 398. 83

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,423.25	175,805.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,000.00	131,400.00
减：应计利息总额	0.95	21.18
减：交易费用	0.30	7.07
买卖债券差价收入	1,422.00	44,377.49

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,066,729.85	1,183,992.04
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	1,066,729.85	1,183,992.04

7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	1,804,379.26	1,932,222.51
股票投资	1,804,379.26	1,932,222.51
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	1,804,379.26	1,932,222.51

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,701.69	54,331.99
基金转换费收入	1,557.38	650.11
合计	3,259.07	54,982.10

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	20,000.00	35,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
债券托管账户维护费	37,500.00	37,200.00
银行划款手续费	2,798.79	4,440.87

合计	140,298.79	156,640.87
----	------------	------------

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	657,091.93	1,235,151.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	305,638.48	519,923.02
应支付基金管理人的净管理费	351,453.45	715,228.57

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

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，本基金的管理费年费率由1.50%调整为1.20%。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	109,515.29	205,858.64

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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，本基金的托管费年费率由0.25%调整为0.20%。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城量化平衡混 合 A	景顺长城量化平衡混 合 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	3.28	3.28
招商银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	3.28	3.28
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城量化平衡混 合 A	景顺长城量化平衡混 合 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	-	-

招商银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	-	-

注：（1）支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

（2）自 2023 年 8 月 28 日起，本基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原有基金份额转为 A 类基金份额。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	3,189,329.85	12,882.31	3,910,930.05	24,301.18

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或约定利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024 年 12 月 23 日	重大事项停牌	7.22	2025 年 1 月 7 日	6.93	5,300	39,931.28	38,266.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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，本基金未持有债券和资产支持证券（上年度末：0.01%）。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	3,189,329.85	-	-	-	-	-	3,189,329.85
结算备付金	235,592.31	-	-	-	-	-	235,592.31
存出保证金	6,166.51	-	-	-	-	-	6,166.51
交易性金融资产	-	-	-	-	-	49,315,462.24	49,315,462.24
应收申购款	-	-	-	-	-	168.21	168.21
资产总计	3,431,088.67	-	-	-	-	49,315,630.45	52,746,719.12
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,087.89	3,087.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	54,381.13	54,381.13
应付托管费	-	-	-	-	-	9,063.50	9,063.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8.66	8.66
其他负债	-	-	-	-	-	172,666.98	172,666.98
负债总计	-	-	-	-	-	239,208.16	239,208.16
利率敏感度缺口	3,431,088.67	-	-	-	-	-	-
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	3,910,930.05	-	-	-	-	-	3,910,930.05
结算备付金	1,350,437.48	-	-	-	-	-	1,350,437.48
存出保证金	6,911.56	-	-	-	-	-	6,911.56
交易性金融资产	-	-	-	-	6,000.45	57,838,901.04	57,844,901.49
应收申购款	-	-	-	-	-	2,194.49	2,194.49
资产总计	5,268,279.09	-	-	-	6,000.45	57,841,095.53	63,115,375.07
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	149,858.19	149,858.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	63,830.77	63,830.77
应付托管费	-	-	-	-	-	10,638.46	10,638.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12.13	12.13
其他负债	-	-	-	-	-	294,825.56	294,825.56
负债总计	-	-	-	-	-	519,165.11	519,165.11

利率敏感度缺口	5,268,279.09	-	-	-6,000.45	-	-
---------	--------------	---	---	-----------	---	---

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.00%（上年度末：0.01%），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）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	49,315,462.24	93.92	57,838,901.04	92.40
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	49,315,462.24	93.92	57,838,901.04	92.40

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）

	沪深 300 指数上升 5%	2, 402, 251. 68	2, 792, 100. 44
	沪深 300 指数下降 5%	-2, 402, 251. 68	-2, 792, 100. 44

7. 4. 14 公允价值

7. 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。

7. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

7. 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	49, 277, 196. 24	57, 838, 901. 04
第二层次	38, 266. 00	6, 000. 45
第三层次	-	-
合计	49, 315, 462. 24	57, 844, 901. 49

7. 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。

7. 4. 14. 2. 3 第三层次公允价值余额及变动情况

7. 4. 14. 2. 3. 1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	

期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	304,055.54	304,055.54
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	304,055.54	304,055.54
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	49,315,462.24	93.49
	其中：股票	49,315,462.24	93.49
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	3,424,922.16	6.49
8	其他各项资产	6,334.72	0.01
9	合计	52,746,719.12	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	257,562.00	0.49
B	采矿业	4,072,542.00	7.76
C	制造业	34,144,510.44	65.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,158,585.00	2.21
E	建筑业	812,336.00	1.55
F	批发和零售业	886,233.00	1.69
G	交通运输、仓储和邮政业	1,020,406.00	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,116,166.80	4.03

J	金融业	3,034,746.00	5.78
K	房地产业	454,161.00	0.86
L	租赁和商务服务业	544,278.00	1.04
M	科学研究和技术服务业	404,437.00	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	46,678.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	14,096.00	0.03
Q	卫生和社会工作	152,510.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	196,215.00	0.37
S	综合	-	-
	合计	49,315,462.24	93.92

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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	000333	美的集团	18,300	1,376,526.00	2.62
2	300750	宁德时代	4,720	1,255,520.00	2.39
3	601899	紫金矿业	75,500	1,141,560.00	2.17
4	002475	立讯精密	23,600	961,936.00	1.83
5	300308	中际旭创	7,420	916,444.20	1.75
6	300502	新易盛	5,400	624,132.00	1.19
7	601318	中国平安	9,700	510,705.00	0.97
8	002594	比亚迪	1,800	508,788.00	0.97
9	600519	贵州茅台	300	457,200.00	0.87
10	601225	陕西煤业	17,600	409,376.00	0.78
11	600660	福耀玻璃	6,100	380,640.00	0.72
12	002001	新 和 成	16,700	366,899.00	0.70
13	600887	伊利股份	12,000	362,160.00	0.69
14	000651	格力电器	7,600	345,420.00	0.66
15	002128	电投能源	17,200	336,776.00	0.64
16	002027	分众传媒	47,600	334,628.00	0.64
17	002463	沪电股份	8,400	333,060.00	0.63
18	600276	恒瑞医药	7,200	330,480.00	0.63
19	601088	中国神华	7,400	321,752.00	0.61
20	603986	兆易创新	2,900	309,720.00	0.59
21	600900	长江电力	10,400	307,320.00	0.59
22	000975	山金国际	19,900	305,863.00	0.58
23	000039	中集集团	38,400	298,368.00	0.57
24	002648	卫星化学	15,600	293,124.00	0.56
25	601877	正泰电器	11,900	278,579.00	0.53

26	000725	京东方 A	63,400	278,326.00	0.53
27	605499	东鹏饮料	1,110	275,857.20	0.53
28	300394	天孚通信	3,019	275,815.84	0.53
29	601939	建设银行	30,800	270,732.00	0.52
30	000528	柳工	21,800	262,908.00	0.50
31	601168	西部矿业	15,800	253,906.00	0.48
32	601601	中国太保	7,200	245,376.00	0.47
33	300866	安克创新	2,400	234,336.00	0.45
34	600031	三一重工	14,100	232,368.00	0.44
35	002180	纳思达	8,100	228,177.00	0.43
36	300408	三环集团	5,900	227,209.00	0.43
37	600066	宇通客车	8,600	226,868.00	0.43
38	601989	中国重工	46,900	225,589.00	0.43
39	002003	伟星股份	15,000	212,550.00	0.40
40	300529	健帆生物	7,200	211,248.00	0.40
41	002048	宁波华翔	15,800	199,396.00	0.38
42	600019	宝钢股份	28,300	198,100.00	0.38
43	600585	海螺水泥	8,300	197,374.00	0.38
44	002444	巨星科技	6,100	197,335.00	0.38
45	002371	北方华创	500	195,500.00	0.37
46	600256	广汇能源	29,000	195,170.00	0.37
47	601766	中国中车	23,200	194,416.00	0.37
48	000999	华润三九	4,330	191,992.20	0.37
49	002938	鹏鼎控股	5,200	189,696.00	0.36
50	002352	顺丰控股	4,700	189,410.00	0.36
51	600320	振华重工	48,100	188,552.00	0.36
52	000423	东阿阿胶	3,000	188,160.00	0.36
53	300661	圣邦股份	2,300	188,094.00	0.36
54	601127	赛力斯	1,400	186,746.00	0.36
55	600690	海尔智家	6,500	185,055.00	0.35
56	603259	药明康德	3,300	181,632.00	0.35
57	300433	蓝思科技	8,200	179,580.00	0.34
58	600995	南网储能	17,600	178,112.00	0.34
59	600489	中金黄金	14,800	178,044.00	0.34
60	000776	广发证券	10,400	168,584.00	0.32
61	601669	中国电建	30,700	167,622.00	0.32
62	601012	隆基绿能	10,300	161,813.00	0.31
63	002281	光迅科技	3,100	161,727.00	0.31
64	600584	长电科技	3,900	159,354.00	0.30
65	600919	江苏银行	16,200	159,084.00	0.30
66	002250	联化科技	28,800	158,688.00	0.30
67	600096	云天化	6,900	153,870.00	0.29
68	300760	迈瑞医疗	600	153,000.00	0.29

69	002459	晶澳科技	11,000	151,250.00	0.29
70	300054	鼎龙股份	5,700	148,314.00	0.28
71	601117	中国化学	17,800	147,562.00	0.28
72	600037	歌华有线	19,700	146,962.00	0.28
73	603501	韦尔股份	1,400	146,174.00	0.28
74	601137	博威合金	7,200	146,160.00	0.28
75	002385	大北农	33,400	144,622.00	0.28
76	000425	徐工机械	18,200	144,326.00	0.27
77	600522	中天科技	9,900	141,768.00	0.27
78	002831	裕同科技	5,200	140,920.00	0.27
79	600183	生益科技	5,800	139,490.00	0.27
80	000963	华东医药	3,900	134,940.00	0.26
81	601825	沪农商行	15,800	134,458.00	0.26
82	603727	博迈科	11,500	132,020.00	0.25
83	688256	寒武纪	200	131,600.00	0.25
84	002948	青岛银行	33,800	131,144.00	0.25
85	601919	中远海控	8,400	130,200.00	0.25
86	000338	潍柴动力	9,500	130,150.00	0.25
87	000729	燕京啤酒	10,800	130,032.00	0.25
88	600600	青岛啤酒	1,600	129,472.00	0.25
89	002311	海大集团	2,600	127,530.00	0.24
90	600219	南山铝业	32,600	127,466.00	0.24
91	603606	东方电缆	2,400	126,120.00	0.24
92	002179	中航光电	3,200	125,760.00	0.24
93	002815	崇达技术	12,200	124,440.00	0.24
94	002142	宁波银行	5,100	123,981.00	0.24
95	300048	合康新能	24,500	123,480.00	0.24
96	601869	长飞光纤	4,100	122,549.00	0.23
97	000513	丽珠集团	3,200	121,600.00	0.23
98	601838	成都银行	7,100	121,481.00	0.23
99	603993	洛阳钼业	18,200	121,030.00	0.23
100	600885	宏发股份	3,800	120,916.00	0.23
101	603538	美诺华	9,500	120,745.00	0.23
102	600143	金发科技	13,900	120,096.00	0.23
103	600007	中国国贸	4,800	117,408.00	0.22
104	600438	通威股份	5,300	117,183.00	0.22
105	000408	藏格矿业	4,200	116,466.00	0.22
106	603676	卫信康	11,700	116,415.00	0.22
107	300685	艾德生物	5,100	116,280.00	0.22
108	002410	广联达	9,880	116,188.80	0.22
109	601567	三星医疗	3,700	113,812.00	0.22
110	002138	顺络电子	3,600	113,328.00	0.22
111	300627	华测导航	2,700	112,860.00	0.21

112	688235	百济神州	700	112,714.00	0.21
113	600741	华域汽车	6,400	112,704.00	0.21
114	688019	安集科技	800	111,488.00	0.21
115	600737	中粮糖业	10,800	110,268.00	0.21
116	000933	神火股份	6,500	109,850.00	0.21
117	002028	思源电气	1,500	109,050.00	0.21
118	000895	双汇发展	4,200	109,032.00	0.21
119	600491	龙元建设	29,100	108,834.00	0.21
120	301327	华宝新能	1,400	107,394.00	0.20
121	002911	佛燃能源	8,400	106,176.00	0.20
122	003006	百亚股份	4,400	105,556.00	0.20
123	002891	中宠股份	2,900	103,530.00	0.20
124	601668	中国建筑	17,200	103,200.00	0.20
125	002637	赞宇科技	10,400	102,440.00	0.20
126	600196	复星医药	4,100	101,885.00	0.19
127	600418	江淮汽车	2,700	101,250.00	0.19
128	002517	恺英网络	7,400	100,714.00	0.19
129	002683	广东宏大	3,800	100,624.00	0.19
130	002023	海特高新	9,900	100,485.00	0.19
131	688550	瑞联新材	3,200	100,128.00	0.19
132	600350	山东高速	9,700	99,716.00	0.19
133	603893	瑞芯微	900	99,054.00	0.19
134	000768	中航西飞	3,500	98,840.00	0.19
135	002299	圣农发展	6,800	98,464.00	0.19
136	600521	华海药业	5,500	98,285.00	0.19
137	600346	恒力石化	6,400	98,240.00	0.19
138	000524	岭南控股	10,100	97,768.00	0.19
139	600085	同仁堂	2,400	97,416.00	0.19
140	600718	东软集团	9,000	96,930.00	0.18
141	601169	北京银行	15,500	95,325.00	0.18
142	601319	中国人保	12,300	93,726.00	0.18
143	605305	中际联合	3,300	93,489.00	0.18
144	600060	海信视像	4,600	91,724.00	0.17
145	000034	神州数码	2,600	91,130.00	0.17
146	000887	中鼎股份	6,800	89,216.00	0.17
147	002468	申通快递	8,800	89,144.00	0.17
148	603138	海量数据	6,200	89,094.00	0.17
149	002318	久立特材	3,800	88,958.00	0.17
150	002449	国星光电	6,500	88,530.00	0.17
150	600938	中国海油	3,000	88,530.00	0.17
151	600299	安迪苏	7,000	87,850.00	0.17
152	002497	雅化集团	7,500	87,750.00	0.17
153	600062	华润双鹤	4,400	87,120.00	0.17

154	600648	外高桥	7,300	86,943.00	0.17
155	000738	航发控制	3,900	86,736.00	0.17
156	002294	信立泰	2,800	86,604.00	0.16
157	000988	华工科技	2,000	86,600.00	0.16
158	300244	迪安诊断	7,600	86,260.00	0.16
159	601156	东航物流	5,100	86,037.00	0.16
160	603218	日月股份	7,100	85,555.00	0.16
161	603766	隆鑫通用	9,400	85,540.00	0.16
162	601100	恒立液压	1,600	84,432.00	0.16
163	300113	顺网科技	5,000	84,050.00	0.16
164	601628	中国人寿	2,000	83,840.00	0.16
165	600547	山东黄金	3,700	83,731.00	0.16
166	002237	恒邦股份	8,200	82,820.00	0.16
167	605080	浙江自然	3,500	82,250.00	0.16
168	600188	兖矿能源	5,800	82,186.00	0.16
169	600176	中国巨石	7,200	82,008.00	0.16
170	000636	风华高科	5,700	81,795.00	0.16
171	603899	晨光股份	2,700	81,675.00	0.16
172	600872	中炬高新	3,700	81,474.00	0.16
173	002532	天山铝业	10,300	81,061.00	0.15
174	600875	东方电气	5,100	81,039.00	0.15
175	600064	南京高科	10,400	80,808.00	0.15
176	300298	三诺生物	3,100	80,011.00	0.15
177	002032	苏泊尔	1,500	79,815.00	0.15
178	601881	中国银河	5,200	79,196.00	0.15
179	300979	华利集团	1,000	78,650.00	0.15
180	603288	海天味业	1,700	78,030.00	0.15
181	002353	杰瑞股份	2,100	77,679.00	0.15
182	002202	金风科技	7,500	77,475.00	0.15
183	300360	炬华科技	4,600	77,142.00	0.15
184	300741	华宝股份	4,400	76,516.00	0.15
185	603730	岱美股份	8,500	76,415.00	0.15
186	600216	浙江医药	4,800	76,128.00	0.14
187	688123	聚辰股份	1,300	76,076.00	0.14
188	000786	北新建材	2,500	75,775.00	0.14
189	300447	全信股份	5,300	75,101.00	0.14
190	601699	潞安环能	5,200	74,672.00	0.14
191	600893	航发动力	1,800	74,610.00	0.14
192	000807	云铝股份	5,500	74,415.00	0.14
193	300415	伊之密	3,700	74,222.00	0.14
194	300986	志特新材	6,100	74,054.00	0.14
195	601111	中国国航	9,300	73,563.00	0.14
196	300777	中简科技	2,600	73,554.00	0.14

197	600820	隧道股份	10,200	73,338.00	0.14
198	600710	苏美达	7,800	72,540.00	0.14
199	000301	东方盛虹	8,800	72,248.00	0.14
200	600362	江西铜业	3,500	72,240.00	0.14
201	002151	北斗星通	2,700	71,658.00	0.14
202	603258	电魂网络	3,600	71,604.00	0.14
203	603885	吉祥航空	5,200	71,240.00	0.14
204	002273	水晶光电	3,200	71,104.00	0.14
205	603338	浙江鼎力	1,100	70,972.00	0.14
206	601211	国泰君安	3,800	70,870.00	0.13
207	603087	甘李药业	1,600	70,560.00	0.13
208	603966	法兰泰克	9,100	70,252.00	0.13
209	000417	合百集团	11,000	70,180.00	0.13
210	603939	益丰药房	2,900	69,977.00	0.13
211	000921	海信家电	2,400	69,360.00	0.13
212	605358	立昂微	2,800	69,356.00	0.13
213	000596	古井贡酒	400	69,320.00	0.13
214	601665	齐鲁银行	12,400	69,316.00	0.13
215	002466	天齐锂业	2,100	69,300.00	0.13
216	002493	荣盛石化	7,600	68,780.00	0.13
217	002612	朗姿股份	4,200	68,712.00	0.13
218	300223	北京君正	1,000	68,200.00	0.13
219	300587	天铁科技	15,500	68,045.00	0.13
220	000027	深圳能源	10,500	68,040.00	0.13
220	300620	光库科技	1,400	68,040.00	0.13
221	603605	珀莱雅	800	67,760.00	0.13
222	300181	佐力药业	4,400	67,584.00	0.13
223	300015	爱尔眼科	5,000	66,250.00	0.13
224	601717	郑煤机	5,100	66,198.00	0.13
225	601688	华泰证券	3,700	65,083.00	0.12
226	688608	恒玄科技	200	65,074.00	0.12
227	300772	运达股份	4,900	64,876.00	0.12
228	605111	新洁能	1,900	64,429.00	0.12
229	603025	大豪科技	4,200	64,050.00	0.12
230	002791	坚朗五金	2,800	63,672.00	0.12
231	603806	福斯特	4,300	63,640.00	0.12
232	000550	江铃汽车	2,700	63,315.00	0.12
232	688233	神工股份	2,700	63,315.00	0.12
233	300659	中孚信息	3,900	63,141.00	0.12
234	605365	立达信	4,000	62,800.00	0.12
235	300475	香农芯创	2,200	62,678.00	0.12
236	002916	深南电路	500	62,500.00	0.12
237	600089	特变电工	4,900	62,426.00	0.12

238	002286	保龄宝	8,400	61,992.00	0.12
239	300059	东方财富	2,400	61,968.00	0.12
240	000830	鲁西化工	5,300	61,957.00	0.12
241	000881	中广核技	8,400	61,572.00	0.12
242	002661	克明食品	6,100	61,366.00	0.12
243	688008	澜起科技	900	61,110.00	0.12
244	002624	完美世界	5,900	60,947.00	0.12
245	603612	索通发展	4,500	60,795.00	0.12
245	605376	博迁新材	2,100	60,795.00	0.12
246	000758	中色股份	12,200	60,268.00	0.11
247	601390	中国中铁	9,400	60,066.00	0.11
248	300957	贝泰妮	1,400	59,766.00	0.11
249	601336	新华保险	1,200	59,640.00	0.11
250	600563	法拉电子	500	59,460.00	0.11
251	600941	中国移动	500	59,080.00	0.11
252	300274	阳光电源	800	59,064.00	0.11
253	688158	优刻得	4,200	58,716.00	0.11
254	605567	春雪食品	6,500	58,500.00	0.11
255	002906	华阳集团	1,900	58,425.00	0.11
256	688188	柏楚电子	300	58,275.00	0.11
257	300458	全志科技	1,500	58,140.00	0.11
258	603697	有友食品	5,700	58,026.00	0.11
259	002858	力盛体育	5,000	57,200.00	0.11
260	300323	华灿光电	6,900	57,132.00	0.11
261	603600	永艺股份	4,800	57,072.00	0.11
262	601728	中国电信	7,900	57,038.00	0.11
263	688596	正帆科技	1,600	56,880.00	0.11
264	603214	爱婴室	2,500	56,400.00	0.11
265	601818	光大银行	14,500	56,115.00	0.11
266	002533	金杯电工	5,700	56,088.00	0.11
267	000682	东方电子	5,200	55,692.00	0.11
268	600809	山西汾酒	300	55,263.00	0.11
269	600098	广州发展	8,600	55,212.00	0.11
270	002595	豪迈科技	1,100	55,209.00	0.11
271	002946	新乳业	3,800	55,138.00	0.11
272	600642	申能股份	5,800	55,042.00	0.10
273	688099	晶晨股份	800	54,944.00	0.10
274	688176	亚虹医药	8,000	54,320.00	0.10
275	600298	安琪酵母	1,500	54,075.00	0.10
276	600332	白云山	1,900	53,998.00	0.10
277	688088	虹软科技	1,400	53,984.00	0.10
278	601138	工业富联	2,500	53,750.00	0.10
279	600633	浙数文化	5,100	53,346.00	0.10

280	002534	西子洁能	4,800	53,328.00	0.10
281	600027	华电国际	9,400	52,734.00	0.10
282	002384	东山精密	1,800	52,560.00	0.10
283	002705	新宝股份	3,500	52,500.00	0.10
284	601369	陕鼓动力	6,000	52,200.00	0.10
285	605589	圣泉集团	2,200	51,876.00	0.10
286	688380	中微半导	1,700	50,830.00	0.10
287	000966	长源电力	10,600	50,350.00	0.10
288	601288	农业银行	9,300	49,662.00	0.09
289	603209	兴通股份	3,100	49,538.00	0.09
290	000823	超声电子	4,800	49,536.00	0.09
291	600016	民生银行	11,900	49,147.00	0.09
292	601698	中国卫通	2,400	48,960.00	0.09
293	600739	辽宁成大	4,700	48,645.00	0.09
294	600420	国药现代	4,000	47,760.00	0.09
295	603129	春风动力	300	47,121.00	0.09
296	688208	道通科技	1,200	46,992.00	0.09
297	000050	深天马 A	5,200	46,956.00	0.09
298	600988	赤峰黄金	3,000	46,830.00	0.09
299	603067	振华股份	3,700	46,731.00	0.09
300	600008	首创环保	14,200	46,576.00	0.09
301	300346	南大光电	1,200	46,308.00	0.09
302	600380	健康元	4,100	46,207.00	0.09
303	002967	广电计量	2,800	45,920.00	0.09
304	603678	火炬电子	1,500	45,750.00	0.09
305	600406	国电南瑞	1,800	45,396.00	0.09
306	600926	杭州银行	3,100	45,291.00	0.09
307	600352	浙江龙盛	4,400	45,276.00	0.09
308	002550	千红制药	7,200	44,640.00	0.09
309	000735	罗 牛 山	6,700	44,622.00	0.08
310	300624	万兴科技	700	44,205.00	0.08
311	600132	重庆啤酒	700	44,114.00	0.08
312	601689	拓普集团	900	44,100.00	0.08
313	002241	歌尔股份	1,700	43,877.00	0.08
314	002847	盐津铺子	700	43,820.00	0.08
315	002752	昇兴股份	6,900	43,815.00	0.08
316	603733	仙鹤股份	2,100	43,323.00	0.08
317	601998	中信银行	6,200	43,276.00	0.08
318	002091	江苏国泰	5,900	43,188.00	0.08
319	002489	浙江永强	13,300	43,092.00	0.08
320	601155	新城控股	3,600	43,056.00	0.08
321	600578	京能电力	12,200	42,944.00	0.08
322	603296	华勤技术	600	42,570.00	0.08

323	001289	龙源电力	2,700	42,417.00	0.08
324	300132	青松股份	8,600	42,398.00	0.08
325	688586	江航装备	4,400	42,108.00	0.08
326	603530	神马电力	1,700	42,007.00	0.08
327	000538	云南白药	700	41,965.00	0.08
327	000603	盛达资源	3,500	41,965.00	0.08
328	002756	永兴材料	1,100	41,492.00	0.08
329	300318	博晖创新	7,200	41,184.00	0.08
330	601619	嘉泽新能	12,400	41,168.00	0.08
331	688180	君实生物	1,500	40,995.00	0.08
332	000069	华侨城 A	15,300	40,851.00	0.08
333	600030	中信证券	1,400	40,838.00	0.08
334	600728	佳都科技	8,700	40,716.00	0.08
335	000498	山东路桥	6,800	40,460.00	0.08
336	603826	坤彩科技	2,100	40,425.00	0.08
337	300684	中石科技	1,800	40,374.00	0.08
338	688095	福昕软件	600	40,296.00	0.08
339	300406	九强生物	3,000	40,080.00	0.08
340	600015	华夏银行	5,000	40,050.00	0.08
341	002008	大族激光	1,600	40,000.00	0.08
342	300358	楚天科技	5,800	39,788.00	0.08
343	600487	亨通光电	2,300	39,606.00	0.08
344	688399	硕世生物	600	39,432.00	0.08
345	002007	华兰生物	2,300	38,755.00	0.07
346	300598	诚迈科技	800	38,720.00	0.07
347	002252	上海莱士	5,300	38,266.00	0.07
348	300660	江苏雷利	1,000	38,220.00	0.07
349	601611	中国核建	4,200	37,968.00	0.07
350	688322	奥比中光	800	37,200.00	0.07
351	600977	中国电影	3,200	37,152.00	0.07
352	002414	高德红外	5,000	37,150.00	0.07
353	002500	山西证券	5,900	37,052.00	0.07
354	002603	以岭药业	2,300	36,823.00	0.07
355	002558	巨人网络	2,900	36,801.00	0.07
356	600115	中国东航	9,200	36,800.00	0.07
357	002837	英维克	900	36,360.00	0.07
358	600032	浙江新能	4,900	36,260.00	0.07
359	600160	巨化股份	1,500	36,180.00	0.07
360	600054	黄山旅游	3,200	36,160.00	0.07
361	688519	南亚新材	1,700	36,142.00	0.07
362	002106	莱宝高科	3,300	36,003.00	0.07
363	600419	天润乳业	3,800	35,378.00	0.07
364	603565	中谷物流	3,600	35,280.00	0.07

365	600812	华北制药	6,800	35,156.00	0.07
366	688372	伟测科技	600	35,112.00	0.07
367	000935	四川双马	2,400	34,752.00	0.07
368	002011	盾安环境	3,200	34,592.00	0.07
369	600639	浦东金桥	3,100	34,410.00	0.07
370	002019	亿帆医药	3,200	34,304.00	0.07
371	600970	中材国际	3,600	34,128.00	0.06
372	000848	承德露露	3,800	34,086.00	0.06
373	600582	天地科技	5,500	33,990.00	0.06
374	600460	士兰微	1,300	33,826.00	0.06
375	000429	粤高速 A	2,300	33,810.00	0.06
376	002185	华天科技	2,900	33,669.00	0.06
377	600048	保利发展	3,800	33,668.00	0.06
378	600662	外服控股	6,500	32,955.00	0.06
379	300677	英科医疗	1,300	32,864.00	0.06
380	600331	宏达股份	4,300	32,766.00	0.06
381	603609	禾丰股份	3,800	32,756.00	0.06
382	603728	鸣志电器	600	32,400.00	0.06
383	688300	联瑞新材	500	32,200.00	0.06
384	600641	万业企业	2,200	32,164.00	0.06
385	002984	森麒麟	1,300	32,058.00	0.06
386	601231	环旭电子	1,900	31,350.00	0.06
387	301031	中熔电气	300	31,206.00	0.06
388	600764	中国海防	1,100	31,152.00	0.06
389	002901	大博医疗	1,000	30,840.00	0.06
390	603533	掌阅科技	1,500	30,465.00	0.06
391	603337	杰克股份	1,000	30,460.00	0.06
392	603227	雪峰科技	3,500	30,415.00	0.06
393	600862	中航高科	1,200	30,312.00	0.06
394	002064	华峰化学	3,700	30,266.00	0.06
395	002772	众兴菌业	4,100	30,217.00	0.06
396	603383	顶点软件	800	30,000.00	0.06
397	600557	康缘药业	2,200	29,964.00	0.06
398	600100	同方股份	4,200	29,862.00	0.06
399	300481	濮阳惠成	2,000	29,640.00	0.06
400	001914	招商积余	2,800	29,596.00	0.06
401	300662	科锐国际	1,400	29,484.00	0.06
402	300633	开立医疗	1,000	29,390.00	0.06
403	300813	泰林生物	1,700	29,359.00	0.06
404	002850	科达利	300	29,304.00	0.06
405	300779	惠城环保	300	29,280.00	0.06
406	002223	鱼跃医疗	800	29,192.00	0.06
407	600282	南钢股份	6,200	29,078.00	0.06

408	600861	北京人力	1,500	29,025.00	0.06
409	601966	玲珑轮胎	1,600	28,864.00	0.05
410	601811	新华文轩	1,800	28,530.00	0.05
411	601916	浙商银行	9,800	28,518.00	0.05
412	301263	泰恩康	1,900	28,481.00	0.05
413	688002	睿创微纳	600	28,206.00	0.05
414	002242	九阳股份	2,700	27,972.00	0.05
415	600208	衢州发展	9,300	27,528.00	0.05
416	601186	中国铁建	3,000	27,510.00	0.05
417	300643	万通智控	2,300	27,508.00	0.05
418	002597	金禾实业	1,200	27,396.00	0.05
419	301060	兰卫医学	3,000	27,330.00	0.05
420	301029	怡合达	1,100	27,192.00	0.05
421	601398	工商银行	3,900	26,988.00	0.05
422	000878	云南铜业	2,200	26,818.00	0.05
423	002340	格林美	4,100	26,773.00	0.05
424	603798	康普顿	3,000	26,490.00	0.05
425	603301	振德医疗	1,200	26,388.00	0.05
426	300232	洲明科技	3,800	26,106.00	0.05
427	605333	沪光股份	800	26,104.00	0.05
428	600879	航天电子	2,900	25,984.00	0.05
429	002483	润邦股份	4,900	25,529.00	0.05
430	300035	中科电气	1,700	25,415.00	0.05
431	000048	京基智农	1,400	25,200.00	0.05
432	002739	万达电影	2,000	24,280.00	0.05
433	002651	利君股份	3,300	24,189.00	0.05
434	600269	赣粤高速	4,300	24,123.00	0.05
435	601098	中南传媒	1,600	24,016.00	0.05
436	605009	豪悦护理	600	23,976.00	0.05
437	301236	软通动力	400	23,484.00	0.04
438	002212	天融信	3,600	23,220.00	0.04
439	600158	中体产业	2,800	23,156.00	0.04
440	300215	电科院	3,900	23,127.00	0.04
441	300673	佩蒂股份	1,300	23,049.00	0.04
442	002446	盛路通信	3,500	22,925.00	0.04
443	600195	中牧股份	3,400	22,814.00	0.04
444	603369	今世缘	500	22,615.00	0.04
445	301339	通行宝	1,100	22,374.00	0.04
446	300416	苏试试验	1,900	22,344.00	0.04
447	688408	中信博	300	21,600.00	0.04
448	002030	达安基因	3,800	21,584.00	0.04
449	300498	温氏股份	1,300	21,463.00	0.04
450	002472	双环传动	700	21,434.00	0.04

451	600498	烽火通信	1,100	21,406.00	0.04
452	002399	海普瑞	2,000	21,380.00	0.04
453	000825	太钢不锈	6,100	21,228.00	0.04
454	600985	淮北矿业	1,500	21,105.00	0.04
455	600873	梅花生物	2,100	21,063.00	0.04
456	002928	华夏航空	2,700	20,952.00	0.04
457	688200	华峰测控	200	20,900.00	0.04
458	301050	雷电微力	400	20,632.00	0.04
459	688388	嘉元科技	1,400	20,622.00	0.04
460	300409	道氏技术	1,500	20,415.00	0.04
461	002373	千方科技	2,000	20,280.00	0.04
462	688063	派能科技	500	20,025.00	0.04
463	000661	长春高新	200	19,888.00	0.04
464	688777	中控技术	400	19,868.00	0.04
465	300203	聚光科技	1,300	19,799.00	0.04
466	600113	浙江东日	1,400	19,488.00	0.04
467	601975	招商南油	6,200	19,406.00	0.04
468	600572	康恩贝	4,100	19,106.00	0.04
469	603508	思维列控	800	19,024.00	0.04
470	002674	兴业科技	2,000	18,980.00	0.04
471	002372	伟星新材	1,500	18,945.00	0.04
472	002992	宝明科技	300	18,780.00	0.04
473	002991	甘源食品	200	18,704.00	0.04
474	601058	赛轮轮胎	1,300	18,629.00	0.04
475	002153	石基信息	2,600	18,564.00	0.04
476	688469	芯联集成	3,600	18,468.00	0.04
477	300432	富临精工	1,200	18,456.00	0.04
478	300903	科翔股份	2,300	18,377.00	0.03
479	688066	航天宏图	900	18,360.00	0.03
480	002886	沃特股份	1,100	18,282.00	0.03
481	002073	软控股份	2,200	18,172.00	0.03
482	600795	国电电力	3,900	17,862.00	0.03
483	603299	苏盐井神	1,600	17,824.00	0.03
484	603920	世运电路	600	17,640.00	0.03
485	300134	大富科技	1,500	17,595.00	0.03
486	688707	振华新材	1,600	17,520.00	0.03
487	300079	数码视讯	3,200	17,312.00	0.03
488	688336	三生国健	800	17,136.00	0.03
489	601515	东峰集团	4,300	17,114.00	0.03
490	688371	菲沃泰	1,100	17,072.00	0.03
491	000967	盈峰环境	3,400	16,898.00	0.03
492	002035	华帝股份	2,300	16,882.00	0.03
493	601279	英利汽车	4,400	16,852.00	0.03

494	603823	百合花	1,800	16,740.00	0.03
495	600901	江苏金租	3,200	16,704.00	0.03
496	300558	贝达药业	300	16,179.00	0.03
497	600635	大众公用	3,600	16,020.00	0.03
498	600050	中国联通	3,000	15,930.00	0.03
499	000597	东北制药	3,000	15,810.00	0.03
500	600993	马应龙	600	15,666.00	0.03
501	601101	昊华能源	1,900	15,637.00	0.03
502	002498	汉缆股份	4,600	15,594.00	0.03
503	300418	昆仑万维	400	15,392.00	0.03
504	002912	中新赛克	600	15,354.00	0.03
505	603158	腾龙股份	1,900	15,352.00	0.03
506	300285	国瓷材料	900	15,336.00	0.03
507	300887	谱尼测试	2,000	15,280.00	0.03
508	002413	雷科防务	3,500	15,260.00	0.03
509	301205	联特科技	200	15,138.00	0.03
510	603197	保隆科技	400	15,100.00	0.03
511	601001	晋控煤业	1,100	15,037.00	0.03
512	601666	平煤股份	1,500	15,030.00	0.03
513	301012	扬电科技	600	14,970.00	0.03
514	002078	太阳纸业	1,000	14,870.00	0.03
515	600548	深高速	1,100	14,828.00	0.03
516	000877	天山股份	2,600	14,716.00	0.03
517	600150	中国船舶	400	14,384.00	0.03
518	688187	时代电气	300	14,376.00	0.03
519	600765	中航重机	700	14,329.00	0.03
520	002982	湘佳股份	800	14,280.00	0.03
520	688131	皓元医药	400	14,280.00	0.03
521	605098	行动教育	400	14,096.00	0.03
522	688668	鼎通科技	300	14,058.00	0.03
523	603076	乐惠国际	600	13,824.00	0.03
524	688315	诺禾致源	1,100	13,750.00	0.03
525	603236	移远通信	200	13,688.00	0.03
526	000100	TCL 科技	2,700	13,581.00	0.03
527	002334	英威腾	1,800	13,536.00	0.03
528	600858	银座股份	2,400	13,320.00	0.03
529	301080	百普赛斯	300	13,242.00	0.03
530	600637	东方明珠	1,700	13,192.00	0.03
531	688080	映翰通	400	13,168.00	0.03
532	300515	三德科技	1,100	13,101.00	0.02
533	688687	凯因科技	600	12,948.00	0.02
534	603056	德邦股份	900	12,897.00	0.02
535	688508	芯朋微	300	12,891.00	0.02

536	300759	康龙化成	500	12,850.00	0.02
537	301195	北路智控	400	12,844.00	0.02
538	600021	上海电力	1,400	12,838.00	0.02
539	688271	联影医疗	100	12,640.00	0.02
540	300179	四方达	1,100	12,375.00	0.02
541	605060	联德股份	700	12,229.00	0.02
542	600703	三安光电	1,000	12,170.00	0.02
543	002966	苏州银行	1,500	12,165.00	0.02
544	002626	金达威	800	12,080.00	0.02
545	688578	艾力斯	200	11,980.00	0.02
546	688183	生益电子	300	11,778.00	0.02
547	002773	康弘药业	600	11,760.00	0.02
548	002050	三花智控	500	11,755.00	0.02
549	601009	南京银行	1,100	11,715.00	0.02
550	002556	辉隆股份	2,100	11,697.00	0.02
551	600248	陕建股份	2,600	11,648.00	0.02
552	002714	牧原股份	300	11,532.00	0.02
553	300428	立中集团	700	11,410.00	0.02
554	002396	星网锐捷	600	11,394.00	0.02
555	600782	新钢股份	3,400	11,356.00	0.02
556	300138	晨光生物	1,300	11,336.00	0.02
557	603355	莱克电气	500	11,325.00	0.02
558	605337	李子园	1,000	11,290.00	0.02
559	300088	长信科技	1,700	11,118.00	0.02
560	300682	朗新集团	900	10,980.00	0.02
561	300001	特锐德	500	10,975.00	0.02
562	300855	图南股份	500	10,960.00	0.02
563	600803	新奥股份	500	10,840.00	0.02
564	000913	钱江摩托	600	10,806.00	0.02
565	601633	长城汽车	400	10,532.00	0.02
566	688152	麒麟信安	200	10,408.00	0.02
567	600386	北巴传媒	2,300	10,281.00	0.02
568	688439	振华风光	200	10,258.00	0.02
569	688680	海优新材	300	10,134.00	0.02
570	688369	致远互联	500	10,035.00	0.02
571	603515	欧普照明	600	9,870.00	0.02
572	600482	中国动力	400	9,788.00	0.02
573	002120	韵达股份	1,300	9,776.00	0.02
574	600998	九州通	1,900	9,728.00	0.02
575	601456	国联证券	700	9,464.00	0.02
576	688030	山石网科	600	9,300.00	0.02
577	300002	神州泰岳	800	9,272.00	0.02
578	600770	综艺股份	2,200	9,218.00	0.02

579	002415	海康威视	300	9,210.00	0.02
580	601777	力帆科技	1,200	9,180.00	0.02
581	601311	骆驼股份	1,100	9,119.00	0.02
582	603387	基蛋生物	1,100	9,075.00	0.02
583	002422	科伦药业	300	8,979.00	0.02
584	603368	柳药集团	500	8,930.00	0.02
585	603596	伯特利	200	8,918.00	0.02
586	600720	中交设计	1,000	8,860.00	0.02
587	600428	中远海特	1,200	8,760.00	0.02
588	000680	山推股份	900	8,730.00	0.02
589	300373	扬杰科技	200	8,704.00	0.02
590	300012	华测检测	700	8,701.00	0.02
591	600426	华鲁恒升	400	8,644.00	0.02
592	688122	西部超导	200	8,564.00	0.02
593	600058	五矿发展	1,200	8,544.00	0.02
594	000710	贝瑞基因	1,000	8,450.00	0.02
595	600000	浦发银行	800	8,232.00	0.02
596	688589	力合微	300	8,211.00	0.02
597	300305	裕兴股份	1,500	8,175.00	0.02
598	002432	九安医疗	200	8,156.00	0.02
599	600335	国机汽车	1,300	8,099.00	0.02
600	000063	中兴通讯	200	8,080.00	0.02
601	603160	汇顶科技	100	8,054.00	0.02
602	300994	久祺股份	700	7,896.00	0.02
603	688048	长光华芯	200	7,798.00	0.01
604	300696	爱乐达	500	7,765.00	0.01
605	300821	东岳硅材	1,000	7,760.00	0.01
606	000503	国新健康	700	7,686.00	0.01
607	301376	致欧科技	400	7,648.00	0.01
608	300850	新强联	400	7,644.00	0.01
609	001270	铖昌科技	200	7,620.00	0.01
610	688199	久日新材	500	7,525.00	0.01
611	603599	广信股份	600	7,230.00	0.01
612	600323	瀚蓝环境	300	7,086.00	0.01
613	688020	方邦股份	200	7,070.00	0.01
614	300967	晓鸣股份	600	7,050.00	0.01
615	601958	金钼股份	700	7,042.00	0.01
616	603195	公牛集团	100	7,024.00	0.01
617	002745	木林森	800	6,976.00	0.01
618	300699	光威复材	200	6,930.00	0.01
619	603283	赛腾股份	100	6,916.00	0.01
620	301381	赛维时代	300	6,828.00	0.01
621	002139	拓邦股份	500	6,805.00	0.01

622	002270	华明装备	400	6,756.00	0.01
623	300672	国科微	100	6,675.00	0.01
624	601083	锦江航运	700	6,664.00	0.01
625	603166	福达股份	900	6,543.00	0.01
626	000759	中百集团	500	6,540.00	0.01
627	600141	兴发集团	300	6,510.00	0.01
628	603100	川仪股份	300	6,465.00	0.01
629	603162	海通发展	700	6,440.00	0.01
630	600316	洪都航空	200	6,424.00	0.01
631	300513	恒实科技	700	6,391.00	0.01
632	300316	晶盛机电	200	6,380.00	0.01
633	603982	泉峰汽车	800	6,368.00	0.01
634	000422	湖北宜化	500	6,310.00	0.01
635	688009	中国通号	1,000	6,260.00	0.01
636	300918	南山智尚	600	6,186.00	0.01
637	301047	义翘神州	100	6,185.00	0.01
638	603786	科博达	100	6,180.00	0.01
639	600329	达仁堂	200	6,160.00	0.01
640	603171	税友股份	200	6,100.00	0.01
641	300496	中科创达	100	5,956.00	0.01
641	688389	普门科技	400	5,956.00	0.01
642	688107	安路科技	200	5,916.00	0.01
643	600845	宝信软件	200	5,852.00	0.01
644	600378	昊华科技	200	5,782.00	0.01
645	002978	安宁股份	200	5,684.00	0.01
646	688636	智明达	200	5,620.00	0.01
647	002600	领益智造	700	5,600.00	0.01
648	600570	恒生电子	200	5,598.00	0.01
649	603075	热威股份	300	5,589.00	0.01
650	600968	海油发展	1,300	5,551.00	0.01
651	002747	埃斯顿	300	5,550.00	0.01
652	000559	万向钱潮	900	5,535.00	0.01
653	002402	和而泰	300	5,433.00	0.01
654	300811	铂科新材	100	5,391.00	0.01
655	601162	天风证券	1,200	5,376.00	0.01
656	688401	路维光电	200	5,278.00	0.01
657	000977	浪潮信息	100	5,188.00	0.01
658	002056	横店东磁	400	5,184.00	0.01
659	600989	宝丰能源	300	5,052.00	0.01
660	601212	白银有色	1,800	5,004.00	0.01
661	002301	齐心集团	700	4,977.00	0.01
662	301262	海看股份	200	4,974.00	0.01
663	002467	二六三	900	4,968.00	0.01

664	600707	彩虹股份	600	4,932.00	0.01
665	002635	安洁科技	300	4,776.00	0.01
665	600640	国脉文化	400	4,776.00	0.01
666	600237	铜峰电子	700	4,585.00	0.01
667	603040	新坐标	200	4,584.00	0.01
668	603989	艾华集团	300	4,524.00	0.01
669	300482	万孚生物	200	4,482.00	0.01
670	300207	欣旺达	200	4,462.00	0.01
671	600517	国网英大	800	4,408.00	0.01
672	300653	正海生物	200	4,260.00	0.01
673	600867	通化东宝	500	4,030.00	0.01
674	300636	同和药业	500	3,985.00	0.01
675	001258	立新能源	500	3,980.00	0.01
676	002376	新北洋	600	3,912.00	0.01
677	003009	中天火箭	100	3,900.00	0.01
678	002020	京新药业	300	3,840.00	0.01
679	601179	中国西电	500	3,795.00	0.01
680	600973	宝胜股份	600	3,780.00	0.01
681	600975	新五丰	600	3,720.00	0.01
682	601600	中国铝业	500	3,675.00	0.01
683	688225	亚信安全	200	3,642.00	0.01
684	002949	华阳国际	200	3,564.00	0.01
685	002997	瑞鹄模具	100	3,465.00	0.01
686	601069	西部黄金	300	3,435.00	0.01
687	601827	三峰环境	400	3,432.00	0.01
688	001206	依依股份	200	3,306.00	0.01
689	601339	百隆东方	600	3,264.00	0.01
689	603818	曲美家居	1,200	3,264.00	0.01
690	600933	爱柯迪	200	3,260.00	0.01
691	603983	丸美生物	100	3,226.00	0.01
692	688772	珠海冠宇	200	3,216.00	0.01
693	002155	湖南黄金	200	3,146.00	0.01
694	002332	仙琚制药	300	2,982.00	0.01
695	600246	万通发展	400	2,980.00	0.01
696	002461	珠江啤酒	300	2,967.00	0.01
697	600325	华发股份	500	2,880.00	0.01
698	603228	景旺电子	100	2,784.00	0.01
699	000923	河钢资源	200	2,780.00	0.01
700	003012	东鹏控股	400	2,644.00	0.01
701	601860	紫金银行	900	2,565.00	0.00
702	688236	春立医疗	200	2,560.00	0.00
703	600266	城建发展	500	2,550.00	0.00
704	600537	亿晶光电	800	2,456.00	0.00

705	300792	壹网壹创	100	2,400.00	0.00
706	002768	国恩股份	100	2,307.00	0.00
707	603997	继峰股份	200	2,290.00	0.00
708	601988	中国银行	400	2,204.00	0.00
709	600827	百联股份	200	2,186.00	0.00
710	300629	新劲刚	100	2,160.00	0.00
711	688121	卓然股份	200	2,154.00	0.00
712	300485	赛升药业	300	2,103.00	0.00
713	002859	洁美科技	100	2,075.00	0.00
714	001979	招商蛇口	200	2,048.00	0.00
715	600028	中国石化	300	2,004.00	0.00
716	600435	北方导航	200	1,952.00	0.00
717	601999	出版传媒	300	1,881.00	0.00
718	002968	新大正	200	1,842.00	0.00
719	300802	矩子科技	100	1,827.00	0.00
720	601298	青岛港	200	1,822.00	0.00
721	601857	中国石油	200	1,788.00	0.00
722	002244	滨江集团	200	1,722.00	0.00
723	600023	浙能电力	300	1,698.00	0.00
724	002852	道道全	200	1,652.00	0.00
725	603663	三祥新材	100	1,595.00	0.00
726	603308	应流股份	100	1,410.00	0.00
727	600236	桂冠电力	200	1,360.00	0.00
728	605377	华旺科技	100	1,335.00	0.00
729	603115	海星股份	100	1,291.00	0.00
730	601615	明阳智能	100	1,261.00	0.00
731	603085	天成自控	100	1,085.00	0.00
732	600097	开创国际	100	1,014.00	0.00
733	600483	福能股份	100	997.00	0.00
734	600295	鄂尔多斯	100	976.00	0.00
735	002344	海宁皮城	200	930.00	0.00
736	603118	共进股份	100	890.00	0.00
737	002636	金安国纪	100	774.00	0.00
738	300423	昇辉科技	100	692.00	0.00
739	000720	新能泰山	200	650.00	0.00
740	000612	焦作万方	100	642.00	0.00
741	000761	本钢板材	200	640.00	0.00
742	600167	联美控股	100	573.00	0.00
743	600780	通宝能源	100	563.00	0.00
744	600369	西南证券	100	467.00	0.00
745	601991	大唐发电	100	285.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000333	美的集团	2,310,096.00	3.69
2	601899	紫金矿业	2,042,251.00	3.26
3	300750	宁德时代	1,864,838.00	2.98
4	002475	立讯精密	1,792,336.48	2.86
5	300308	中际旭创	1,727,537.80	2.76
6	600276	恒瑞医药	1,531,304.00	2.45
7	300502	新易盛	1,521,269.00	2.43
8	000651	格力电器	1,331,097.00	2.13
9	600519	贵州茅台	1,327,351.00	2.12
10	300394	天孚通信	1,305,613.30	2.09
11	002371	北方华创	1,271,500.00	2.03
12	601225	陕西煤业	1,201,771.00	1.92
13	601318	中国平安	1,151,700.00	1.84
14	600941	中国移动	1,122,831.00	1.79
15	002594	比亚迪	1,105,423.00	1.77
16	603501	韦尔股份	1,061,918.00	1.70
17	601601	中国太保	1,056,876.00	1.69
18	300866	安克创新	1,053,939.00	1.68
19	603259	药明康德	1,050,567.00	1.68
20	603993	洛阳钼业	1,040,542.00	1.66

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	1,890,510.00	3.02
2	000568	泸州老窖	1,610,973.00	2.57
3	000333	美的集团	1,404,257.00	2.24
4	600519	贵州茅台	1,404,243.00	2.24
5	603259	药明康德	1,371,065.00	2.19
6	600938	中国海油	1,287,804.00	2.06
7	300760	迈瑞医疗	1,275,021.00	2.04
8	300394	天孚通信	1,273,274.00	2.03
9	600276	恒瑞医药	1,260,520.00	2.01
10	300308	中际旭创	1,223,368.40	1.95
11	600900	长江电力	1,208,217.00	1.93
12	300122	智飞生物	1,201,390.00	1.92

13	601138	工业富联	1,169,770.00	1.87
14	000651	格力电器	1,168,101.00	1.87
15	002371	北方华创	1,161,787.00	1.86
16	601688	华泰证券	1,159,780.00	1.85
17	600161	天坛生物	1,154,812.40	1.84
18	603993	洛阳钼业	1,139,781.00	1.82
19	600887	伊利股份	1,099,015.00	1.76
20	600941	中国移动	1,097,662.00	1.75

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。

8.4.3 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	345,866,810.27
卖出股票收入（成交）总额	354,770,971.06

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 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。

8.12.3 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	6,166.51
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	168.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,334.72

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	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 (%)
景顺长城 量化平衡 混合 A	2,200	21,237.51	-	-	46,722,520.46	100.00
景顺长城 量化平衡 混合 C	14	1,070.13	-	-	14,981.81	100.00
合计	2,214	21,109.98	-	-	46,737,502.27	100.00

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	景顺长城量化平衡混合 A	99.99	0.000214
	景顺长城量化平衡混合 C	12.91	0.086171
	合计	112.90	0.000242

9.3 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、本期末基金的基金经理未持有本基金。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城量化平衡混合 A	景顺长城量化平衡混合 C
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	55,888,742.26	20,032.37

额总额		
本报告期基金总申购份额	955,676.11	88,551.58
减：本报告期基金总赎回份额	10,121,897.91	93,602.14
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	46,722,520.46	14,981.81

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 7 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 20,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安证券股份有限公司	2	126,874,009.38	18.11	99,761.03	18.98	未变更
华泰证券股份有限公司	2	77,759,882.83	11.10	55,126.48	10.49	未变更
山西证券股份有限公司	2	65,715,964.60	9.38	62,161.99	11.83	本期报告新增2个
财通证券股份有限公司	1	64,311,636.54	9.18	48,153.22	9.16	未变更
东吴证券股份有限公司	2	43,183,969.11	6.16	31,918.52	6.07	未变更
中泰证券股份有限公司	2	36,977,197.52	5.28	21,059.44	4.01	未变更
长江证券股份有限公司	2	32,122,615.16	4.58	25,337.36	4.82	未变更
华鑫证券有限责任公司	1	32,104,803.96	4.58	21,309.14	4.05	未变更
广发证券股份有限公司	1	30,524,624.02	4.36	16,677.17	3.17	未变更
方正证券股份有限公司	2	27,132,784.10	3.87	21,876.05	4.16	未变更
国海证券股份有限公司	2	25,504,639.61	3.64	11,604.59	2.21	未变更
摩根大通证券（中	1	24,781,174.27	3.54	18,449.51	3.51	未变更

国)有限公司						
信达证券股份有限公司	2	24,179,277.57	3.45	22,872.15	4.35	未变更
德邦证券股份有限公司	2	21,716,834.50	3.10	15,219.83	2.90	未变更
中信建投证券股份有限公司	3	15,280,644.00	2.18	6,953.08	1.32	未变更
川财证券有限责任公司	1	13,957,902.00	1.99	13,202.72	2.51	未变更
华安证券股份有限公司	1	13,608,474.30	1.94	12,872.92	2.45	未变更
首创证券股份有限公司	2	12,487,928.64	1.78	11,812.63	2.25	未变更
中信证券股份有限公司	3	12,413,419.22	1.77	9,259.20	1.76	未变更
财信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	本期报告退租 1 个
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
华兴证券有限公司	1	-	-	-	-	未变更
江海证券有限公司	2	-	-	-	-	未变更
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
太平洋证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
五矿证券有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中国银河	1	-	-	-	-	未变

证券股份 有限公司						更
--------------	--	--	--	--	--	---

注：1、基金管理人选择交易单元的标准为：交易单元所属券商财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强。

2、基金管理人选择交易单元参与证券交易的程序为：基金管理人定期对符合上述标准的券商进行测评，测评结果是决定后期使用各证券公司交易单元参与证券交易的依据。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	7,423.25	100.00	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

华鑫证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
方正证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国海证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券 (中国) 有限公 司	-	-	-	-	-	-
信达证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
德邦证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
川财证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
华安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
首创证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

中信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
财信证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
华创证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
华兴证 券有限 公司	-	-	-	-	-	-
江海证 券有限 公司	-	-	-	-	-	-
平安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
太平洋 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	-	-	-	-	-	-

11.8 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终止北京增财基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 19 日
3	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
4	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	2024 年 1 月 22 日

	券投资基金 2023 年第 4 季度报告	网站	
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 22 日
6	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
7	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
8	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日
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	2024 年 4 月 13 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	2024 年 4 月 15 日
11	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金 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
12	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
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 21 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	2024 年 5 月 24 日
15	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	2024 年 5 月 25 日
16	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 25 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 31 日
18	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	2024 年 6 月 14 日
19	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
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 6 月 29 日
21	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 7 月 16 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 7 月 19 日
23	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 7 月 19 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 7 月 26 日

25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 8 月 23 日
26	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 8 月 30 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 8 月 30 日
28	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 9 月 6 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 10 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 20 日
31	景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 20 日
32	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 28 日
33	景顺长城基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 8 日
34	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 21 日
35	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 23 日
36	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 25 日
37	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 25 日
38	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 11 月 15 日
39	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 11 月 22 日
40	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 11 月 26 日
41	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 11 月 28 日
42	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	2024 年 11 月 28 日
43	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 12 月 6 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 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

2025 年 3 月 28 日