

景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中
基金 (FOF)
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月27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2025年1月1日起至2025年6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 | 7 |
| 2.5 其他相关资料 | 7 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 8 |
| 3.3 其他指标 | 10 |
| § 4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 13 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 13 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 净资产变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 43 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 43 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 44 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 44 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 45 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 46 |
| 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 | 46 |
| 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 | 46 |
| 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 | 46 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 46 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 46 |
| 7.12 本报告期投资基金情况 | 46 |
| 7.13 投资组合报告附注 | 51 |
| § 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 | 52 |
| 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 | 52 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 53 |
| § 10 重大事件揭示 | 53 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 53 |
| 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 | 53 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 53 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 54 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的主要影响事件 | 54 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 54 |
| 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 54 |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 54 |
| 10.9 其他重大事件 | 59 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 61 |
| 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 | 61 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 61 |
| § 12 备查文件目录 | 61 |
| 12.1 备查文件目录 | 61 |
| 12.2 存放地点 | 62 |
| 12.3 查阅方式 | 62 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---------------------------|---------------------|
| 基金名称 | 景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金（FOF） | |
| 基金简称 | 景顺长城臻品三个月持有混合（FOF） | |
| 基金主代码 | 021638 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2024年12月26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 | 80,330,383.10份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）A | 景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）C |
| 下属分级基金的交易代码 | 021638 | 021639 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 18,612,606.12份 | 61,717,776.98份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金在合理控制投资组合风险的前提下，通过优选基金，力争获取超越业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | <p>(一) 大类资产配置策略 本基金在宏观经济分析基础上，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，结合政策面、市场资金面，积极把握市场发展趋势，对权益类资产、债券类资产、商品类资产及现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整。</p> <p>本基金是基金中基金，投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的80%，同时，本基金将拟投资的资产分为权益类资产和非权益类资产两类。</p> <p>(二) 基金投资策略</p> <p>1、战略型资产配置策略（SAA） 本基金基于对国内外宏观经济周期和货币周期变化情况的深度研究，综合考虑宏观经济、政策及法规和资本市场因素，并结合各类资产的长期收益率、历史波动率、各类资产之间的相关性等指标，确定并动态调整权益类基金、固定收益类基金、商品基金（含商品期货基金和黄金ETF）等各类基金资产的配置比例。</p> <p>2、战术型资产配置策略（TAA） 在基金资产配置比例确定的前提下，基金管理人将根据中短期市场环境的变化，通过择时及类别配置等方式调节各类资产之间的分配比例，优化短期的投资收益与风险。其中针对权益类资产的策略主要包括择时策略和行业轮动策略。</p> <p>3、基金优选策略</p> |

| | |
|--------|--|
| | <p>本基金在确定大类资产配置基础上，优选子基金构建组合。</p> <p>（三）股票、港股通标的股票及存托凭证投资策略</p> <p>本基金通过结合证券市场趋势，并以基本面研究为基础，精选基本面良好，具有较好盈利能力和市场竞争力的公司，寻找股票的超预期机会。</p> <p>（四）债券投资策略</p> <p>（1）出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。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，确定债券资产配置。</p> <p>（2）可转换债券和可交换债券投资策略。首先通过对可转换债券和可交换债券转股溢价率和 Delta 系数的度量，筛选出股性或债性较强的品种作为下一阶段的投资重点。</p> <p>（五）公募 REITs 投资策略</p> <p>本基金将综合考量宏观经济运行情况、基金资产配置策略、底层资产运营情况、流动性及估值水平等因素，对公募 REITs 的投资价值进行深入研究，精选出具有较高投资价值的公募 REITs 进行投资。本基金根据投资策略需要或市场环境变化，可选择将部分基金资产投资于公募 REITs，但本基金并非必然投资公募 REITs。</p> <p>（六）资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率 \times 70% + 恒生指数收益率（使用估值汇率折算） \times 5% + 中债综合（全价）指数收益率 \times 15% + 一年期定期存款基准利率（税后） \times 10% |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金中基金，在通常情况下其预期收益和预期风险水平高于债券型基金中基金、债券型基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。</p> <p>本基金可投资港股通标的股票，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|------------------------------|-----------------------------|
| 名称 | | 景顺长城基金管理有限公司 | 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@igwfmc.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 | 叶才 | 缪建民 |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2025年1月1日-2025年6月30日) | |
|---------------|---------------------------|----------------------|
| | 景顺长城臻品三个月持有混合(FOF) A | 景顺长城臻品三个月持有混合(FOF) C |
| 本期已实现收益 | 1,027,651.63 | 2,144,281.26 |
| 本期利润 | 3,200,456.26 | 5,051,017.93 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0432 | 0.0408 |
| 本期加权平均净值利润率 | 4.30% | 4.06% |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.20% | 5.98% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 599,343.86 | 1,850,626.57 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0322 | 0.0300 |
| 期末基金资产净值 | 19,737,515.73 | 65,307,969.80 |
| 期末基金份额净值 | 1.0604 | 1.0581 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2025年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 6.04% | 5.81% |

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

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

数。

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

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

5、本基金基金合同生效日为2024年12月26日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）A

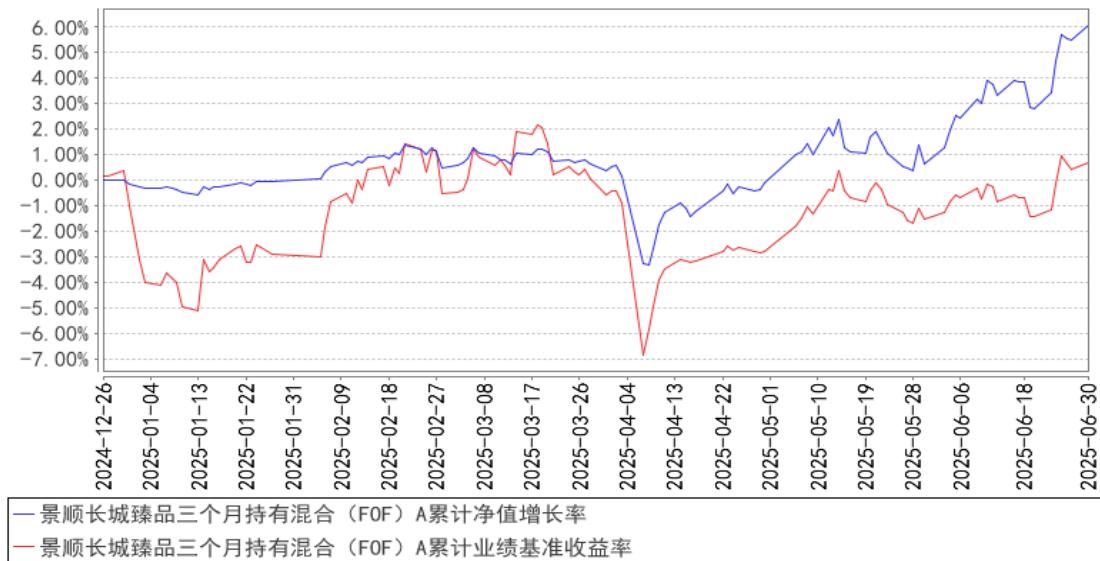
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 5.34% | 0.55% | 2.28% | 0.47% | 3.06% | 0.08% |
| 过去三个月 | 5.62% | 0.70% | 1.29% | 0.93% | 4.33% | -0.23% |
| 过去六个月 | 6.20% | 0.52% | 1.70% | 0.84% | 4.50% | -0.32% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.04% | 0.51% | 0.71% | 0.83% | 5.33% | -0.32% |

景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）C

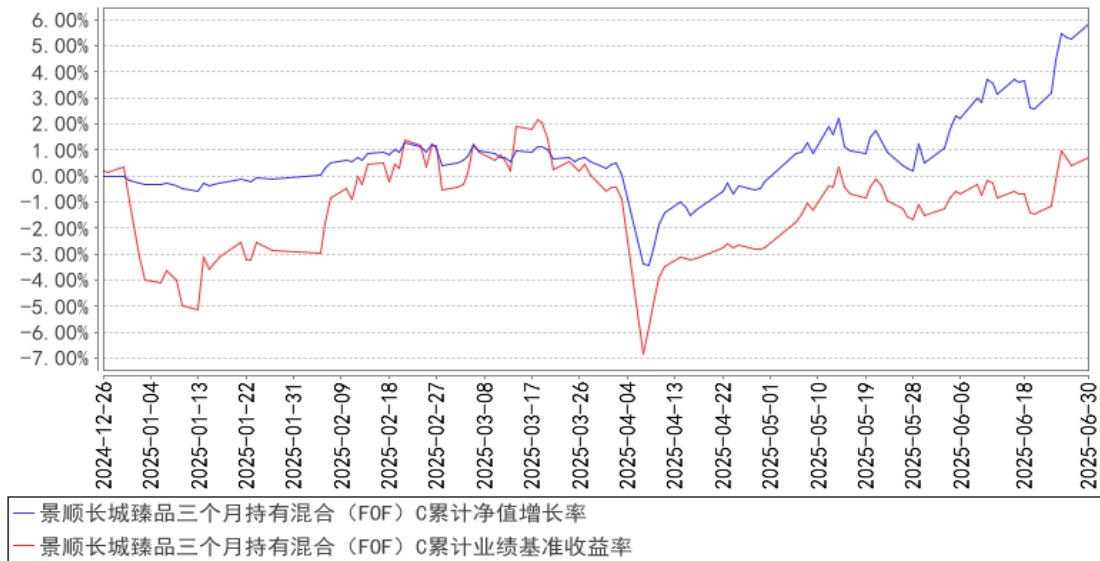
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 5.29% | 0.54% | 2.28% | 0.47% | 3.01% | 0.07% |
| 过去三个月 | 5.50% | 0.70% | 1.29% | 0.93% | 4.21% | -0.23% |
| 过去六个月 | 5.98% | 0.52% | 1.70% | 0.84% | 4.28% | -0.32% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.81% | 0.51% | 0.71% | 0.83% | 5.10% | -0.32% |

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

景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）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



景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）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：基金的投资组合比例为：投资经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于本基金资产的 80%；本基金投资于股票、股票型基金和权益类混合型基金等权益类资产占基金资产的比例为 60%–95%；本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%；本基金投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例不高于本基金资产的 20%；本基金保持现金或者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。权益类资产指股票、股票型基金和权益类混合型基金，权益类混合型基金指至少满足以下一条标准的混合型基金：（1）基金合同约定投资股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于 60%；

(2) 基金最近连续四个季度定期报告中披露的股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例均在60%以上。本基金的建仓期为自2024年12月26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。报告期末距离建仓结束期未满一年。基金合同生效日（2024年12月26日）起至本报告期末不满一年。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2025年6月30日，本公司旗下共管理199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 | | |
| 江虹 | 本基金的基金经理 | 2024年12月26日 | - | 15年 | 工商管理硕士。曾任华泰人寿保险股份有限公司精算部产品精算专员，光大证券股份有限公司销售交易部高级经理，海通证券股份有限公司研究所高级经理，中信保诚人寿保险有限公司基金投资部投资经理，中信保诚资产管理有限责任公司基金投资部投资经理。2021年7月加入本公司，自2021年9月起担任养老及资产配置部基金经理。具有15年证券、基金行业从业经验。 |

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理办法》、《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、《景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金（FOF）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5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

本基金定位为在承受一定波动的情况下以期获取更好的资本增值的产品，属于中高风险产品。在2025年上半年，本基金依旧采取多元化投资策略，以尽量确保净值曲线的稳定，在风险和机遇之间取得平衡。

1) 中国资产：一季度我们在风险预算内，提升了港股互联网及A股科技的仓位。港股互联网板块经过2023-2024年的深度调整，估值处于低位，2025年初，海外市场的不稳定性推动全球资金回流新兴市场，港股流动性显著改善。国内平台经济监管进入常态化阶段，企业合规成本下降，叠加AI技术赋能（如电商、云计算）带来的第二增长曲线，头部互联网公司盈利预期上修。半导体设备、工业软件等“卡脖子”领域获专项政策支持（如《科技自立自强2030行动方案》），

国产化率提升明显。生成式 AI 向垂直行业渗透，国内大模型厂商与金融机构、制造业客户签订商业化合同时有消息，在这种环境下，我们认为科技估值有望提升。在二季度，我们结构优化捕捉科技红利。在风险预算内，维持港股互联网的核心仓位但聚焦 AI 商业化落地标的，适当增持了 A 股科技的仓位，国内对科技创新及新质生产力的政策支持力度持续加码（如大规模设备更新、算力基础设施建设等），板块显现一定修复迹象，并重新吸引部分海外中长期配置资金的关注。

2) 海外资产：一季度我们因国际形势复杂性提升，我们降低海外资产的配置比例。二季度随着关税暂缓和减税预期提振信心，叠加标普 500 盈利修复和科技革命的进展持续演绎，我们提升美股纳指的仓位。

3) 债券方面：一季度我们降低了债券的久期，以防御利率风险。在整个一季度，我们债券的久期都在极低水平。但是进入二季度，我们对债券态度转为中性，提升了债券久期。

4) 另类方面：一季度黄金配置整体处于略微超配状态，二季度随着黄金波动性增加，我们适当降低了黄金的配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 6.20%，业绩比较基准收益率为 1.70%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 5.98%，业绩比较基准收益率为 1.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

看好中国资产下半年的表现，核心驱动在于政策发力（财政/降息）与科技盈利修复（AI 商业化+国产替代加速）。因此配置上我们目前认为结构重于指数，相对看好“哑铃策略”，继续把握好科技与红利双主线。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行

业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人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，控制执行中可能产生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2025年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2025年6月30日 | 上年度末 2024年12月31日 |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6. 4. 7. 1 | 6, 629, 738. 12 | 24, 275, 763. 17 |
| 结算备付金 | | 640, 257. 20 | — |
| 存出保证金 | | 26, 432. 38 | — |
| 交易性金融资产 | 6. 4. 7. 2 | 83, 692, 831. 77 | 216, 741, 654. 03 |
| 其中：股票投资 | | 3, 565, 958. 60 | — |
| 基金投资 | | 76, 076, 050. 16 | 205, 857, 828. 28 |
| 债券投资 | | 4, 050, 823. 01 | 10, 883, 825. 75 |
| 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 | | 5, 248, 454. 41 | — |
| 应收股利 | | 6, 499. 93 | — |
| 应收申购款 | | — | — |
| 递延所得税资产 | | — | — |
| 其他资产 | 6. 4. 7. 8 | 5, 174. 72 | — |
| 资产总计 | | 96, 249, 388. 53 | 241, 017, 417. 20 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2025年6月30日 | 上年度末 2024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. 36 | 859, 784. 38 |
| 应付赎回款 | | 10, 929, 175. 72 | — |

| | | | |
|-------------|----------|---------------|----------------|
| 应付管理人报酬 | | 47,682.45 | 32,791.59 |
| 应付托管费 | | 14,253.59 | 6,558.31 |
| 应付销售服务费 | | 24,371.40 | 8,398.84 |
| 应付投资顾问费 | | — | — |
| 应交税费 | | 90,443.29 | — |
| 应付利润 | | — | — |
| 递延所得税负债 | | — | — |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 97,976.19 | 10,000.00 |
| 负债合计 | | 11,203,903.00 | 917,533.12 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 80,330,383.10 | 240,461,045.09 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | — | — |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 4,715,102.43 | -361,161.01 |
| 净资产合计 | | 85,045,485.53 | 240,099,884.08 |
| 负债和净资产总计 | | 96,249,388.53 | 241,017,417.20 |

注：报告截止日2025年6月30日，基金份额总额80,330,383.10份，其中本基金A类份额净值人民币1.0604元，基金份额18,612,606.12份；本基金C类份额净值人民币1.0581元，基金份额61,717,776.98份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2025年1月1日至2025年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|---------------------------|----------|----------------------------|
| 一、营业收入 | | 9,050,283.55 |
| 1. 利息收入 | | 34,906.00 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 34,906.00 |
| 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） | | 3,721,371.23 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | 103,254.34 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.15 | 2,871,320.84 |
| 债券投资收益 | 6.4.7.16 | 51,220.44 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.17 | — |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.18 | — |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.19 | — |
| 股利收益 | 6.4.7.20 | 695,575.61 |
| 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. 21 | 5,079,541.30 |
| 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. 22 | 214,465.02 |
| 减: 二、营业总支出 | | 798,809.36 |
| 1. 管理人报酬 | 6. 4. 10. 2. 1 | 301,223.77 |
| 其中: 暂估管理人报酬 | | — |
| 2. 托管费 | 6. 4. 10. 2. 2 | 166,367.30 |
| 3. 销售服务费 | 6. 4. 10. 2. 3 | 247,582.25 |
| 4. 投资顾问费 | | — |
| 5. 利息支出 | | 1,231.60 |
| 其中: 卖出回购金融资产支出 | | 1,231.60 |
| 6. 信用减值损失 | 6. 4. 7. 24 | — |
| 7. 税金及附加 | | 9,763.25 |
| 8. 其他费用 | 6. 4. 7. 25 | 72,641.19 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 8,251,474.19 |
| 减: 所得税费用 | | — |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 8,251,474.19 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | — |
| 六、综合收益总额 | | 8,251,474.19 |

6.3 净资产变动表

会计主体: 景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金(FOF)

本报告期: 2025年1月1日至2025年6月30日

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 | | | |
|----------------------|----------------------|------|--------|-----------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 |
| 一、上期期末净资产 | 240,461,045.09 | — | — | -361,161.01 |
| 加: 会计政策变更 | — | — | — | — |
| 前期差错更正 | — | — | — | — |
| 其他 | — | — | — | — |
| 二、本期期初净资产 | 240,461,045.09 | — | — | -361,161.01 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -160,130,661.99 | — | — | 5,076,263.44 |
| | | | | -155,054,398.55 |

| | | | | |
|--|-----------------|---|---------------|-----------------|
| (一)、综合收益总额 | - | - | 8,251,474.19 | 8,251,474.19 |
| (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) | -160,130,661.99 | - | -3,175,210.75 | -163,305,872.74 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 498,086.37 | - | 16,125.25 | 514,211.62 |
| 2. 基金赎回款 | -160,628,748.36 | - | -3,191,336.00 | -163,820,084.36 |
| (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 | 80,330,383.10 | - | 4,715,102.43 | 85,045,485.53 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金(FOF)(以下简称“本基金”),系根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]845号文《关于准予景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金(FOF)注册的批复》,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《景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》作为发起人向社会公开募集,经向中国证监会备案,基金合同于2024年12月26日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金募集期间为2024年11月28日至2024年12月24日,设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币240,377,827.92元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币83,217.17元,以上实收基金(本息)合计为人民币

240,461,045.09 元，折合 240,461,045.09 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2024）验字第 70015711_H13 号验资报告予以验证。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《景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》和《景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产净值中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。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，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（含商品基金、公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”）、香港互认基金、ETF 和 LOF、QDII 基金及其他经中国证监会核准或注册的基金）、国内依法发行上市的股票（包括创业板以及其他中国证监会核准或注册上市的股票和存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具及中国证监会允许基金中基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

本基金的投资组合比例为：投资经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于本基金资产的 80%；本基金投资于股票、股票型基金和权益类混合型基金等权益类资产占基金资产的比例为 60%–95%；本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%；本基金投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例不高于本基金资产的 20%；本基金保持现金或者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。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率 \times 70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算） \times 5%+中债综合（全价）指数收益率 \times 15%+一年期定期存款基准利率（税后） \times 10%。

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 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2025年6月30日的财务状况以及2025年1月1日至2025年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2025年1月1日至2025年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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。

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

（1）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、地方政府债券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。

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 2025年6月30日 |
|----------------|-------------------|
| 活期存款 | 6,629,738.12 |
| 等于： 本金 | 6,629,125.65 |
| 加： 应计利息 | 612.47 |
| 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 | 6,629,738.12 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025年6月30日 | | | |
|-------------------|-------------------|--------------|--------------|--------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 3,561,201.02 | — | 3,565,958.60 | 4,757.58 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | — | — | — | — |
| 债券 | 交易所市场 | 4,004,960.37 | 50,823.01 | 4,050,823.01 |
| | 银行间市场 | — | — | — |
| | 合计 | 4,004,960.37 | 50,823.01 | 4,050,823.01 |
| | | | | -4,960.37 |

| | | | | |
|--------|---------------|-----------|---------------|--------------|
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | 71,309,778.99 | - | 76,076,050.16 | 4,766,271.17 |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 78,875,940.38 | 50,823.01 | 83,692,831.77 | 4,766,068.38 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末的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

本基金本报告期末的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

本基金本报告期末的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

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|-------|------------|
| | 2025年6月30日 |
| 应收利息 | — |
| 其他应收款 | 5,174.72 |
| 待摊费用 | — |
| 合计 | 5,174.72 |

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|-------------|------------|
| | 2025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 | 23,592.43 |
| 其中：交易所市场 | 23,592.43 |
| 银行间市场 | — |
| 应付利息 | — |
| 预提费用 | 74,383.76 |
| 合计 | 97,976.19 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）A

| 项目 | 本期 | |
|---------------|----------------------|----------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 | 账面金额 |
| 上年度末 | 86,752,071.48 | 86,752,071.48 |
| 本期申购 | 104,077.70 | 104,077.70 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -68,243,543.06 | -68,243,543.06 |
| 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 | 18,612,606.12 | 18,612,606.12 |

景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）C

| 项目 | 本期 | |
|------|----------------------|----------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 | 账面金额 |
| 上年度末 | 153,708,973.61 | 153,708,973.61 |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期申购 | 394,008.67 | 394,008.67 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -92,385,205.30 | -92,385,205.30 |
| 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 | 61,717,776.98 | 61,717,776.98 |

注：（1）申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

（2）本基金合同于2024年12月26日生效。首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币240,377,827.92元，折合240,377,827.92份基金份额（其中A类基金份额86,722,265.57份，C类基金份额153,655,562.35份）；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币83,217.17元，折合83,217.17份基金份额（其中A类基金份额29,805.91份，C类基金份额53,411.26份）。以上收到的实收基金共计人民币240,461,045.09元，折合240,461,045.09份基金份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|--------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | -14,174.76 | -113,096.06 | -127,270.82 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | -14,174.76 | -113,096.06 | -127,270.82 |
| 本期利润 | 1,027,651.63 | 2,172,804.63 | 3,200,456.26 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -414,133.01 | -1,534,142.82 | -1,948,275.83 |
| 其中：基金申购款 | 392.72 | -1,280.80 | -888.08 |
| 基金赎回款 | -414,525.73 | -1,532,862.02 | -1,947,387.75 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 599,343.86 | 525,565.75 | 1,124,909.61 |

景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------|------------|-------------|-------------|
| 上年度末 | -33,513.33 | -200,376.86 | -233,890.19 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | -33,513.33 | -200,376.86 | -233,890.19 |

| | | | |
|----------------|--------------|--------------|---------------|
| 本期利润 | 2,144,281.26 | 2,906,736.67 | 5,051,017.93 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -260,141.36 | -966,793.56 | -1,226,934.92 |
| 其中：基金申购款 | 7,863.64 | 9,149.69 | 17,013.33 |
| 基金赎回款 | -268,005.00 | -975,943.25 | -1,243,948.25 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,850,626.57 | 1,739,566.25 | 3,590,192.82 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 34,285.15 |
| 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 | 600.06 |
| 其他 | 20.79 |
| 合计 | 34,906.00 |

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 |
|------------------|----------------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 103,254.34 |
| 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 | 103,254.34 |

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 |
|------------|----------------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 33,991,560.03 |
| 减：卖出股票成本总额 | 33,803,111.50 |
| 减：交易费用 | 85,194.19 |
| 买卖股票差价收入 | 103,254.34 |

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------|----------------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 卖出/赎回基金成交总额 | 297,485,648.10 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 294,518,765.84 |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | 81,360.40 |
| 减：交易费用 | 14,201.02 |
| 基金投资收益 | 2,871,320.84 |

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------------|----------------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 60,451.07 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -9,230.63 |
| 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 | 51,220.44 |

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 6,873,215.81 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 6,808,432.63 |
| 减：应计利息总额 | 74,013.81 |
| 减：交易费用 | - |
| 买卖债券差价收入 | -9,230.63 |

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益**6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|----------------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 38,469.99 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | — |
| 基金投资产生的股利收益 | 657,105.62 |
| 合计 | 695,575.61 |

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | 5,079,541.30 |
| 股票投资 | 4,757.58 |
| 债券投资 | -11,007.37 |
| 资产支持证券投资 | — |
| 基金投资 | 5,085,791.09 |
| 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 | 5,079,541.30 |

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 164,474.89 |
| 销售服务费返还 | 49,990.13 |
| 合计 | 214,465.02 |

6.4.7.23 持有基金产生的费用

| 项目 | 本期 |
|----------------------|----------------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 49,990.46 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 342,953.23 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 86,766.10 |

注：上述费用按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法估算得出，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.24 信用减值损失

无。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 审计费用 | 14,876.39 |
| 信息披露费 | 49,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行划款手续费 | 7,735.24 |
| 其他 | 400.00 |
| 证券组合费 | 122.19 |
| 合计 | 72,641.19 |

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

| 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 |
| 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。

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

本基金本报告期未有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 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 301,223.77 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 483,211.94 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | -181,988.17 |

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费，支付销售机构的客户维护费不因投资于基金管理人所管理的公开募集证券投资基金而调减，因此应支付基金管理人的净管理费可能为负。支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的 1.00%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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 166,367.30 |

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的 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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 | | |
|----------------|----------------------------|---------------------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）A | 景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）C | 合计 |
| 景顺长城基金管理有限公司 | - | 9.05 | 9.05 |
| 招商银行 | - | 218,160.54 | 218,160.54 |
| 长城证券 | - | - | - |
| 合计 | - | 218,169.59 | 218,169.59 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率计提，

逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期末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

本基金于本报告期末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。

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 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| | |

| | 期末余额 | 当期利息收入 |
|---------|--------------|-----------|
| 招商银行-活期 | 6,629,738.12 | 34,285.15 |

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。

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于2025年6月30日，本基金持有基金管理人景顺长城基金管理有限公司所管理的公开募集证券投资基金合计人民币41,464,503.04元，占本基金资产净值的比例为48.76%。（于2024年12月31日，本基金持有基金管理人景顺长城基金管理有限公司所管理的公开募集证券投资基金合计人民币199,285,522.28元，占本基金资产净值的比例为83.00%。）

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|----------------------|----------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元） | 280.56 |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | 9,469.18 |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费(元) | 49,990.13 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 268,058.74 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 68,812.65 |

注：1、上述交易基金产生的申购费包含场外基金申购/转入费用及场内基金买入交易费用，交易基金产生的赎回费包含场外基金赎回/转出费用及场内基金卖出交易费用；

2、上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；销售服务费、管理费和托管费已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成基金的费用项目；

3、根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

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（2025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

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

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2025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2025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发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理规定》（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时间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，并按照合约规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 2025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 | 6,629,738.12 | - | - | - | - | - | 6,629,738.12 |
| 结算备付金 | 640,257.20 | - | - | - | - | - | 640,257.20 |
| 存出保证金 | 26,432.38 | - | - | - | - | - | 26,432.38 |
| 交易性金融资产 | 4,050,823.01 | - | - | - | - | 79,642,008.76 | 83,692,831.77 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 6,499.93 | 6,499.93 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 5,248,454.41 | 5,248,454.41 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | 5,174.72 | 5,174.72 |
| 资产总计 | 11,347,250.71 | - | - | - | - | 84,902,137.82 | 96,249,388.53 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 10,929,175.72 | 10,929,175.72 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 47,682.45 | 47,682.45 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 14,253.59 | 14,253.59 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 0.36 | 0.36 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 24,371.40 | 24,371.40 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 90,443.29 | 90,443.29 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 97,976.19 | 97,976.19 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 11,203,903.00 | 11,203,903.00 |
| 利率敏感度缺口 | 11,347,250.71 | - | - | - | - | - | - |
| 上年度末 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 | 24,275,763.17 | - | - | - | - | - | 24,275,763.17 |
| 交易性金融资产 | - | - | 10,883,825.75 | - | - | 205,857,828.28 | 216,741,654.03 |
| 资产总计 | 24,275,763.17 | - | 10,883,825.75 | - | - | 205,857,828.28 | 241,017,417.20 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 32,791.59 | 32,791.59 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 6,558.31 | 6,558.31 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 859,784.38 | 859,784.38 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 8,398.84 | 8,398.84 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 10,000.00 | 10,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 917,533.12 | 917,533.12 |
| 利率敏感度缺口 | 24,275,763.17 | - | 10,883,825.75 | - | - | - | - |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--------------------|---------|-----------------------------|
| 假设 | 除市场利率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（2025年6月30日） | | 上年度末（2024年12月31日） |
| | 市场利率上升25个基点 | -684.14 | -15,184.55 |
| | 市场利率下降25个基点 | 685.04 | 15,213.97 |

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 2025年6月30日 | | 上年度末 2024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 | 3,565,958.60 | 4.19 | — | — |
| 交易性金融资产—基金投资 | 76,076,050.16 | 89.45 | 205,857,828.28 | 85.74 |
| 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 | 79,642,008.76 | 93.64 | 205,857,828.28 | 85.74 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | |
|----|-----------------------|
| 假设 | 除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变 |
|----|-----------------------|

| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元) | |
|----|-------------|-----------------------------|-------------------|
| | | 本期末(2025年6月30日) | 上年度末(2024年12月31日) |
| | 沪深300指数上升5% | 3,085,225.22 | 864,288.97 |
| | 沪深300指数下降5% | -3,085,225.22 | -864,288.97 |

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 2025年6月30日 | 上年度末 2024年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次 | 79,642,008.76 | 205,857,828.28 |
| 第二层次 | 4,050,823.01 | 10,883,825.75 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 83,692,831.77 | 216,741,654.03 |

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 | 3,565,958.60 | 3.70 |
| | 其中：股票 | 3,565,958.60 | 3.70 |
| 2 | 基金投资 | 76,076,050.16 | 79.04 |
| 3 | 固定收益投资 | 4,050,823.01 | 4.21 |
| | 其中：债券 | 4,050,823.01 | 4.21 |
| | 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 | 7,269,995.32 | 7.55 |
| 8 | 其他各项资产 | 5,286,561.44 | 5.49 |
| 9 | 合计 | 96,249,388.53 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 3,093,018.60 | 3.64 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 472,940.00 | 0.56 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|--------------|------|
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,565,958.60 | 4.19 |

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 | 300926 | 博俊科技 | 23,500 | 622,045.00 | 0.73 |
| 2 | 600760 | 中航沈飞 | 10,000 | 586,200.00 | 0.69 |
| 3 | 002801 | 微光股份 | 16,600 | 537,342.00 | 0.63 |
| 4 | 688239 | 航宇科技 | 14,000 | 489,720.00 | 0.58 |
| 5 | 301031 | 中熔电气 | 5,624 | 447,951.60 | 0.53 |
| 6 | 688522 | 纳睿雷达 | 8,000 | 409,760.00 | 0.48 |
| 7 | 300525 | 博思软件 | 20,000 | 291,200.00 | 0.34 |
| 8 | 300674 | 宇信科技 | 6,000 | 181,740.00 | 0.21 |

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 | 02400 | 心动公司 | 1,165,373.12 | 0.49 |
| 2 | 600415 | 小商品城 | 1,031,958.00 | 0.43 |
| 3 | 000596 | 古井贡酒 | 1,020,720.00 | 0.43 |
| 4 | 300752 | 隆利科技 | 893,325.00 | 0.37 |
| 5 | 002371 | 北方华创 | 866,831.00 | 0.36 |
| 6 | 688552 | 航天南湖 | 811,800.64 | 0.34 |
| 7 | 600673 | 东阳光 | 805,912.00 | 0.34 |
| 8 | 300926 | 博俊科技 | 738,192.00 | 0.31 |
| 9 | 00981 | 中芯国际 | 734,797.03 | 0.31 |
| 10 | 600760 | 中航沈飞 | 701,325.00 | 0.29 |
| 11 | 688510 | 航亚科技 | 688,937.64 | 0.29 |
| 12 | 600901 | 江苏金租 | 652,827.00 | 0.27 |
| 13 | 00992 | 联想集团 | 648,776.92 | 0.27 |
| 14 | 09868 | 小鹏汽车-W | 635,780.39 | 0.26 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 15 | 00268 | 金蝶国际 | 605,083.76 | 0.25 |
| 16 | 03896 | 金山云 | 600,207.86 | 0.25 |
| 17 | 688239 | 航宇科技 | 593,069.48 | 0.25 |
| 18 | 01415 | 高伟电子 | 591,816.26 | 0.25 |
| 19 | 02498 | 速腾聚创 | 583,009.00 | 0.24 |
| 20 | 002801 | 微光股份 | 564,637.00 | 0.24 |

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|--------------|----------------|
| 1 | 02400 | 心动公司 | 1,258,683.67 | 0.52 |
| 2 | 600415 | 小商品城 | 1,239,260.00 | 0.52 |
| 3 | 300752 | 隆利科技 | 1,025,109.00 | 0.43 |
| 4 | 688552 | 航天南湖 | 930,203.96 | 0.39 |
| 5 | 000596 | 吉井贡酒 | 868,690.00 | 0.36 |
| 6 | 600673 | 东阳光 | 806,428.00 | 0.34 |
| 7 | 002371 | 北方华创 | 793,601.00 | 0.33 |
| 8 | 00992 | 联想集团 | 737,637.16 | 0.31 |
| 9 | 00268 | 金蝶国际 | 723,152.72 | 0.30 |
| 10 | 688510 | 航亚科技 | 721,623.53 | 0.30 |
| 11 | 600901 | 江苏金租 | 693,058.00 | 0.29 |
| 12 | 00981 | 中芯国际 | 677,206.00 | 0.28 |
| 13 | 09868 | 小鹏汽车-W | 629,749.80 | 0.26 |
| 14 | 02252 | 微创机器人-B | 596,673.37 | 0.25 |
| 15 | 02208 | 金风科技 | 561,240.23 | 0.23 |
| 16 | 02498 | 速腾聚创 | 558,410.78 | 0.23 |
| 17 | 00425 | 敏实集团 | 551,617.68 | 0.23 |
| 18 | 01415 | 高伟电子 | 545,216.76 | 0.23 |
| 19 | 002049 | 紫光国微 | 520,352.00 | 0.22 |
| 20 | 300577 | 开润股份 | 510,930.00 | 0.21 |

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 | 37,364,312.52 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 33,991,560.03 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|--------------|
| | | | |

| | | | |
|----|-----------|--------------|------|
| 1 | 国家债券 | 4,050,823.01 | 4.76 |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | — | — |
| | 其中：政策性金融债 | — | — |
| 4 | 企业债券 | — | — |
| 5 | 企业短期融资券 | — | — |
| 6 | 中期票据 | — | — |
| 7 | 可转债（可交换债） | — | — |
| 8 | 同业存单 | — | — |
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 4,050,823.01 | 4.76 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 019749 | 24国债15 | 40,000 | 4,050,823.01 | 4.76 |

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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

1、投资政策

本基金基于对国内外宏观经济周期和货币周期变化情况的深度研究，综合考虑宏观经济、政策及法规和资本市场因素，并结合各类资产的长期收益率、历史波动率、各类资产之间的相关性等指标，确定并动态调整权益类基金、固定收益类基金、商品基金（含商品期货基金和黄金ETF）

等各类基金资产的配置比例。

在基金资产配置比例确定的前提下，基金管理人将根据中短期市场环境的变化，通过择时及类别配置等方式调节各类资产之间的分配比例，优化短期的投资收益与风险。其中针对权益类资产的策略主要包括择时策略和行业轮动策略。

本基金在确定大类资产配置基础上，优选子基金构建组合。

2、风险说明

（1）本基金为混合型基金中基金，在通常情况下其预期收益和预期风险水平高于债券型基金中基金、债券型基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。虽然本基金管理人采用风险控制策略，但是各类资产所在市场如股票市场、债券市场、海外市场等的变化将影响到本基金的业绩表现和投资目标的实现。在极端情形下，本基金可能面临本金亏损的风险。

（2）本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于本基金资产的 80%。因此，本基金所持有的基金的业绩表现、持有基金的基金管理人水平等因素将影响到本基金的业绩表现。基金赎回的资金交收效率慢于基础证券市场交易的证券，因此本基金赎回款实际到达投资者账户的时间可能晚于普通境内开放式基金，存在对投资者资金安排造成影响的风险。

（3）本基金的最短持有期限为三个月，在基金份额的三个月持有期到期日前（不含当日），基金份额持有人不能对该基金份额提出赎回或转换转出申请；基金份额的三个月持有期到期日起（含当日），基金份额持有人可对该基金份额提出赎回或转换转出申请。基金份额持有人将面临在三个月持有期到期前不能赎回基金份额的风险。

（4）本基金为基金中基金，本基金运作中，收取管理费、托管费等。本基金资产中投资于本基金管理人管理的基金的部分不收取管理费。本基金资产中投资于基金托管人托管的基金的部分不收取托管费。本基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金(ETF 除外)，基金管理人应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。

本基金资产投资于其他基金管理人管理的基金或其他基金托管人托管的基金，除了本基金管理人对本基金该部分资产收取管理费、托管费等，所投子基金将收取包括但不限于管理费、托管费、申购费、赎回费、销售服务费等。本基金承担的相关费用可能比普通开放式基金高。

（5）本基金的主要投资范围为公开募集证券投资基金，本基金主要通过申购、二级市场买入或转换入的方式获得基金份额，通过赎回、二级市场卖出或转换出的方式变现基金份额。如占本基金相当比例的被投资基金拒绝或暂停申购/赎回，基金管理人无法找到其他合适的可替代的基金

品种时，本基金可能暂停或拒绝申购、暂停或延缓支付赎回款项。

（6）投资标的的风险。本基金以经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金作为主要投资标的，其所投资的公开募集证券投资基金本身面临着市场风险、流动性风险、管理风险、信用风险等。因此，本基金所持有的公开募集证券投资基金的风险可能会间接或直接地成为本基金的风险。

（7）商品基金的风险。商品基金资产与商品现货价格高度相关，商品现货价格变化将导致商品类基金等价格变化的风险。成本、市场需求、市场环境、气候、时间、地域、生产、宗教信仰、文化等众多直接和间接的因素都会影响商品的价格。另外，商品基金还存在 ETF 流动性风险、ETF 跟踪误差风险、期货杠杆风险等。

（8）沪港深/港股通基金的风险。本基金除可通过港股通机制直接投资香港市场外，还可能通过投资于沪港深/港股通基金投资于香港市场。故而本基金面临着港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

（9）香港互认基金及 QDII 基金的风险。本基金可投资于香港互认基金、QDII 基金。投资于境外基金面临着海外市场风险、汇率风险、政策风险、税务风险等。

（10）公募 REITs 的风险。公募 REITs 采用“公募基金+基础设施资产支持证券”的产品结构，主要特点如下：一是公募 REITs 与投资股票或债券的公募基金具有不同的风险收益特征，80%以上基金资产投资于基础设施资产支持证券，并持有其全部份额，基金通过基础设施资产支持证券持有基础设施项目公司全部股权，穿透取得基础设施项目完全所有权或经营权利；二是公募 REITs 以获取基础设施项目租金、收费等稳定现金流为主要目的，收益分配比例不低于合并后基金年度可供分配金额的 90%；三是公募 REITs 采取封闭式运作，不开放申购与赎回，在证券交易所上市，存在流动性不足的风险。场外份额持有人需将基金份额转托管至场内才可卖出或申报预受要约。

（11）子基金收益不达预期的风险：基金管理人在构建投资组合的时候，对子基金的选择在很大的程度上依靠了子基金的过往业绩。但是子基金的过往业绩往往不能代表子基金未来的表现。本基金投资目标的实现建立在子基金投资目标实现的基础上。如果由于子基金管理人未能实现投资目标，则本基金存在达不成投资目标的风险。

（12）子基金风格偏离风险：本基金筛选子基金策略依靠定性及定量的方法对子基金的风格进行研判，并精选适合投资目标的基金。因此当子基金投资风格出现偏离，会使得本基金存在收益不达预期的风险。

（13）子基金的流动性风险：子基金可能因为暂停估值、基金资产估值存在重大不确定性、连续巨额赎回等情形时实施暂停赎回、延缓支付赎回款项、延期办理赎回申请、对单个投资者赎

回比例确认的情形，存在流动性风险。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|-------------------|-------------|--------------|--------------|--------------|------------------------|
| 1 | 007537 | 景顺长城景泰盈利纯债券 | 契约型开放式 | 5,370,000.00 | 6,548,178.00 | 7.70 | 是 |
| 2 | 512800 | 华宝中证银行ETF | 交易型开放式(ETF) | 3,600,000.00 | 6,159,600.00 | 7.24 | 否 |
| 3 | 513980 | 景顺长城中证港股通科技ETF | 交易型开放式(ETF) | 8,000,000.00 | 5,744,000.00 | 6.75 | 是 |
| 4 | 000385 | 景顺长城景颐双利债券A类 | 契约型开放式 | 2,858,934.18 | 5,014,570.55 | 5.90 | 是 |
| 5 | 007760 | 景顺长城沪港深红利成长低波指数C类 | 契约型开放式 | 3,058,406.71 | 3,969,506.07 | 4.67 | 是 |
| 6 | 159850 | H股50 | 交易型开放式(ETF) | 4,397,000.00 | 3,891,345.00 | 4.58 | 否 |
| 7 | 159941 | 纳指ETF | 交易型开放式(ETF) | 3,150,000.00 | 3,861,900.00 | 4.54 | 否 |
| 8 | 002796 | 景顺长城景盈双利债券A类 | 契约型开放式 | 3,095,361.06 | 3,792,126.83 | 4.46 | 是 |
| 9 | 015683 | 景顺长城科技创新混合C | 契约型开放式 | 2,340,000.00 | 3,107,286.00 | 3.65 | 是 |
| 10 | 518880 | 华安黄金易(ETF) | 交易型开放式(ETF) | 407,000.00 | 2,976,798.00 | 3.50 | 否 |
| 11 | 015751 | 景顺长城品质长青混合C | 契约型开放式 | 2,000,000.00 | 2,478,600.00 | 2.91 | 是 |

| | | | | | | | |
|----|--------|-----------------|---------------|--------------|--------------|------|---|
| 12 | 004719 | 景顺长城睿成混合C类 | 契约型开放式 | 1,500,000.00 | 2,380,350.00 | 2.80 | 是 |
| 13 | 159562 | 黄金股 | 交易型开放式(ETF) | 1,400,000.00 | 2,266,600.00 | 2.67 | 否 |
| 14 | 517180 | 南方富时中国国企开放共赢ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,438,000.00 | 2,080,786.00 | 2.45 | 否 |
| 15 | 159732 | 消费电子 | 交易型开放式(ETF) | 2,500,000.00 | 2,042,500.00 | 2.40 | 否 |
| 16 | 015775 | 景顺长城品质成长混合C | 契约型开放式 | 1,720,046.16 | 1,953,284.42 | 2.30 | 是 |
| 17 | 000242 | 景顺长城策略精选灵活配置混合A | 契约型开放式 | 677,985.34 | 1,878,697.38 | 2.21 | 是 |
| 18 | 513190 | 华夏中证港股通内地金融ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,117,000.00 | 1,859,805.00 | 2.19 | 否 |
| 19 | 513530 | 港股红利 | 交易型开放式(ETF) | 1,080,000.00 | 1,747,440.00 | 2.05 | 否 |
| 20 | 513500 | 博时标普500ETF | 交易型开放式(ETF) | 830,000.00 | 1,744,660.00 | 2.05 | 否 |
| 21 | 018998 | 景顺长城研究精选股票C | 契约型开放式 | 909,944.00 | 1,476,839.11 | 1.74 | 是 |
| 22 | 159998 | 计算机 | 交易型开放式(ETF) | 1,552,000.00 | 1,401,456.00 | 1.65 | 否 |
| 23 | 010350 | 景顺长城品质长青混合A | 契约型开放式 | 944,911.65 | 1,186,809.03 | 1.40 | 是 |
| 24 | 501025 | 鹏华香港银行指数A(LOF) | 上市契约型开放式(LOF) | 700,015.00 | 1,144,174.52 | 1.35 | 否 |
| 25 | 000688 | 景顺长城研究精选股票A | 契约型开放式 | 622,277.54 | 1,021,157.44 | 1.20 | 是 |

| | | | | | | | |
|----|--------|------------------|-------------|--------------|--------------|------|---|
| 26 | 512710 | 富国中证军工龙头 ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,450,000.00 | 1,007,750.00 | 1.18 | 否 |
| 27 | 159851 | 金科 ETF | 交易型开放式(ETF) | 600,000.00 | 1,004,400.00 | 1.18 | 否 |
| 28 | 159632 | 纳斯达克 | 交易型开放式(ETF) | 517,000.00 | 952,831.00 | 1.12 | 否 |
| 29 | 017167 | 景顺长城策略精选灵活配置混合 C | 契约型开放式 | 334,713.42 | 913,098.21 | 1.07 | 是 |
| 30 | 513690 | 博时恒生高股息 ETF | 交易型开放式(ETF) | 461,200.00 | 469,501.60 | 0.55 | 否 |

7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

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 | 26,432.38 |
| 2 | 应收清算款 | 5,248,454.41 |
| 3 | 应收股利 | 6,499.93 |
| 4 | 应收利息 | — |
| 5 | 应收申购款 | — |
| 6 | 其他应收款 | 5,174.72 |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 5,286,561.44 |

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

| 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（%） |
| 景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）A | 98 | 189,924.55 | - | - | 18,612,606.12 | 100.00 |
| 景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）C | 117 | 527,502.37 | 11,002,565.00 | 17.83 | 50,715,211.98 | 82.17 |
| 合计 | 215 | 373,629.69 | 11,002,565.00 | 13.70 | 69,327,818.10 | 86.30 |

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|---------------------|-----------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）A | - | - |
| | 景顺长城臻品三个月持有混合（FOF）C | 30,029.70 | 0.048656 |
| | 合计 | 30,029.70 | 0.037383 |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位: 份

| 项目 | 景顺长城臻品三个月持有混合(FOF) A | 景顺长城臻品三个月持有混合(FOF) C |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
| 基金合同生效日(2024年12月26日)基金份额总额 | 86,752,071.48 | 153,708,973.61 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 86,752,071.48 | 153,708,973.61 |
| 本报告期基金总申购份额 | 104,077.70 | 394,008.67 |
| 减: 本报告期基金总赎回份额 | 68,243,543.06 | 92,385,205.30 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 18,612,606.12 | 61,717,776.98 |

注: 申购含红利再投、转换入份额; 赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内, 本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动:

1、本基金管理人于2025年4月2日发布公告, 经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过, 聘任卫学文先生担任本公司副总经理。

2、本基金管理人于2025年5月30日发布公告, 因李进董事长任期届满, 由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。本基金管理人于2025年8月6日发布公告, 经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过, 聘任叶才先生担任本公司董事长。本基金管理人于2025年8月15日发布公告, 经深圳市市场监督管理局核准, 景顺长城基金管理有限公司法定代表人变更为叶才先生。

有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

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

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼, 报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期未更换会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 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。

10.7.2 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------------|--------|---------------|-----------------|-----------|---------------|----------|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例（%） | 佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | |
| 中泰证券股份有限公司 | 2 | 15,168,319.81 | 21.26 | 6,901.69 | 21.26 | 本期报告新增2个 |
| 东吴证券股份有限公司 | 2 | 13,343,279.60 | 18.70 | 6,071.46 | 18.70 | 本期报告新增2个 |
| 华创证券有限责任公司 | 1 | 6,315,335.26 | 8.85 | 2,873.25 | 8.85 | 本期报告新增1个 |
| 长江证券股份有限公司 | 2 | 5,659,319.80 | 7.93 | 2,574.86 | 7.93 | 本期报告新增2个 |
| 国海证券股份有限公司 | 2 | 5,253,471.44 | 7.36 | 2,390.40 | 7.36 | 本期报告新增 |

| | | | | | | |
|----------------|---|--------------|------|----------|------|----------|
| | | | | | | 2个 |
| 华泰证券股份有限公司 | 2 | 4,483,510.54 | 6.28 | 2,039.99 | 6.28 | 本期报告新增2个 |
| 申万宏源证券有限公司 | 1 | 3,435,618.81 | 4.81 | 1,563.16 | 4.81 | 本期报告新增1个 |
| 摩根大通证券（中国）有限公司 | 1 | 3,277,149.65 | 4.59 | 1,491.10 | 4.59 | 本期报告新增1个 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 3 | 2,550,134.87 | 3.57 | 1,160.21 | 3.57 | 本期报告新增3个 |
| 广发证券股份有限公司 | 1 | 2,361,045.73 | 3.31 | 1,074.28 | 3.31 | 本期报告新增1个 |
| 华鑫证券有限责任公司 | 1 | 2,099,059.83 | 2.94 | 954.82 | 2.94 | 本期报告新增1个 |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | 1,572,124.63 | 2.20 | 715.33 | 2.20 | 本期报告新增1个 |
| 方正证券股份有限公司 | 2 | 1,385,107.49 | 1.94 | 630.21 | 1.94 | 本期报告新增2个 |
| 中信证券股份有限公司 | 3 | 1,240,225.38 | 1.74 | 564.31 | 1.74 | 本期报告新增3个 |
| 平安证券股份有限公司 | 2 | 1,212,879.33 | 1.70 | 551.87 | 1.70 | 本期报告新增2个 |
| 国泰海通证券股份有限公司 | 2 | 1,160,027.38 | 1.63 | 527.80 | 1.63 | 本期报告新增2个 |

| | | | | | | |
|-------------|---|------------|------|--------|------|----------|
| 财通证券股份有限公司 | 1 | 839,263.00 | 1.18 | 381.87 | 1.18 | 本期报告新增1个 |
| 川财证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 本期报告新增1个 |
| 德邦证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 本期报告新增2个 |
| 国信证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 本期报告新增1个 |
| 华安证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 本期报告新增1个 |
| 华兴证券有限公司 | 1 | - | - | - | - | 本期报告新增1个 |
| 江海证券有限公司 | 2 | - | - | - | - | 本期报告新增2个 |
| 山西证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 本期报告新增2个 |
| 首创证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 本期报告新增2个 |
| 太平洋证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 本期报告新增1个 |
| 五矿证券有限公司 | 2 | - | - | - | - | 本期报告新增2个 |
| 信达证券 | 2 | - | - | - | - | 本期 |

| | | | | | | | |
|--------|--|--|--|--|--|--|--------|
| 股份有限公司 | | | | | | | 报告新增2个 |
|--------|--|--|--|--|--|--|--------|

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。

10.8.2 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 | | 基金交易 | |
|----------------|--------------|-----------------|--------------|-------------------|------|-----------------|---------------|-----------------|
| | 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（%） | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例（%） |
| 中泰证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | 9,895,893.89 | 8.08 |
| 东吴证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | 16,720,215.00 | 13.66 |
| 华创证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - | 3,503,948.70 | 2.86 |
| 长江证券股份有限公司 | 1,399,762.00 | 20.59 | 3,570,000.00 | 37.30 | - | - | 7,389,734.90 | 6.04 |
| 国海证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | 9,259,614.40 | 7.57 |
| 华泰证券股份有限公司 | 999,880.00 | 14.71 | - | - | - | - | 8,968,721.80 | 7.33 |
| 申万宏源证券有限公司 | - | - | - | - | - | - | 2,610,372.30 | 2.13 |
| 摩根大通证券（中国）有限公司 | - | - | 4,000,000.00 | 41.80 | - | - | 15,385,887.70 | 12.57 |

| | | | | | | | | | |
|--------------|--------------|-------|--------------|-------|---|---|---|---------------|-------|
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | 1,146,560.20 | 0.94 |
| 广发证券股份有限公司 | 2,799,720.00 | 41.18 | 2,000,000.00 | 20.90 | - | - | - | 26,290,521.00 | 21.48 |
| 华鑫证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - | - | 5,566,046.80 | 4.55 |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | 10,950,300.70 | 8.95 |
| 方正证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | 994,296.00 | 0.81 |
| 中信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰海通证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | 227,461.80 | 0.19 |
| 财通证券股份有限公司 | 1,599,840.00 | 23.53 | - | - | - | - | - | 3,489,119.00 | 2.85 |
| 川财证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华兴证券有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|-------------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 股份有限公司 | | | | | | | | |
| 首创证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 五矿证券有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |

10.9 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 | 关于不法分子冒用景顺长城基金APP及员工名义进行非法活动的澄清公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年1月3日 |
| 2 | 关于不法分子冒用景顺长城基金APP及员工名义进行非法活动的澄清公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年1月3日 |
| 3 | 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 | 2025年1月6日 |
| 4 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金2025年非港股通交易日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回及转换业务安排的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年1月21日 |
| 5 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增利得基金为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年1月24日 |
| 6 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年2月25日 |
| 7 | 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 | 2025年3月19日 |
| 8 | 景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金（FOF）关于开放日常申购、赎回及转换业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年3月24日 |
| 9 | 关于景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金（FOF）参加部分销售机构申购费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年3月24日 |
| 10 | 景顺长城基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年3月31日 |
| 11 | 景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年4月2日 |
| 12 | 景顺长城基金管理有限公司关于提请 | 中国证监会指定报刊及 | 2025年4月14日 |

| | | | |
|----|---|--------------|------------|
| | 投资者及时更新或完善身份信息的公告 | 网站 | |
| 13 | 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 | 2025年4月15日 |
| 14 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年4月16日 |
| 15 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2025年第1季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年4月22日 |
| 16 | 景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金（FOF）2025年第1季度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年4月22日 |
| 17 | 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 | 2025年4月23日 |
| 18 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏财富为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年4月24日 |
| 19 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增开源证券为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年5月8日 |
| 20 | 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 | 2025年5月12日 |
| 21 | 关于不法分子冒用景顺长城基金及股东方APP进行非法活动的澄清公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年5月20日 |
| 22 | 关于不法分子冒用景顺长城基金及股东方APP进行非法活动的澄清公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年5月20日 |
| 23 | 景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金（FOF）2025年第1号更新招募说明书 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年5月24日 |
| 24 | 景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年5月24日 |
| 25 | 景顺长城基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年5月30日 |
| 26 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增肯特瑞为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年6月12日 |
| 27 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝证券为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2025年6月19日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|---------------|------|------|---------------|---------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比（%） |
| 个人 | 1 | 20250612-20250630 | 20,005,400.00 | - | - | 20,005,400.00 | 24.90 |

产品特有风险

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

1、大额申购风险

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

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

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

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

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

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

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

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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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臻品三个月持有期混合型基金中基金（FOF）募集注册的文件；
- 2、《景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》；

- 4、《景顺长城臻品三个月持有期混合型基金中基金（FOF）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

2025年8月29日