

景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金

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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 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 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人及基金托管人	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合规守信情况的说明	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合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金	
基金简称	景顺长城量化成长演化混合	
基金主代码	009992	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 18 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	213,845,517.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城量化成长演化混合 A	景顺长城量化成长演化混合 C
下属分级基金的交易代码	009992	023269
报告期末下属分级基金的份额总额	213,845,072.45 份	445.41 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。本基金注重对中国经济演化趋势的研究，在本基金界定的成长演化主题范围内，通过量化多因子模型精选股票，力争获取行业成长红利和个股超额收益。
投资策略	（一）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，重点关注包括 GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，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。 （二）股票投资策略 1、成长演化主题的界定 本基金所定义的“成长演化”投资主题，“成长”指未来发展潜力较大，且成长性可持续的行业，“演化”指符合中国经济演化趋势的行业。本基金在兼顾“成长”和“演化”两方面考察标准的情况下，筛选出符合相关标准的行业。 2、行业配置策略 成长演化主题的各个行业之间的配置，主要通过分析行业的流动性、市值、景气度、宏观周期所处阶段、估值和盈利趋势等方面，综合评估后进行权重配置和动态调整。 3、个股投资策略 在本基金界定的成长演化主题范围内，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。 （三）债券投资策略 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、资金流动情况的研究，结合宏观经济模型（MEM），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，确定债券类的资产配置。 （四）资产支持证券投资策略 基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，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，结合信用研究和流动性管理，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。 （五）股指期货投资策略 本基金参与股指期货交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。 （六）国债期货投资策略 本基金可基于谨慎原则，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。 （七）股票期权投资策略 本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。 （八）融资策略 本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，对冲系统性风险，实现保值和锁定收益。 （九）现金管理策略 出于对流动性、有效利用基金资产的考量，本基金适时对各类现金管理工具进行投资。本基金主要通过协议存款、剩余期限一年以内的债券、货币市场工具及债券回购等方式进行现金管理。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳	方圆
	联系电话	0755-82370388	95559
	电子邮箱	investor@igwfm.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		4008888606	95559

传真	0755-22381339	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518048	200336
法定代表人	叶才	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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)	2025 年 1 月 27 日(C 类份额首个估值日) -2025 年 6 月 30 日
	景顺长城量化成长演化混合 A	景顺长城量化成长演化混合 C
本期已实现收益	12, 513, 936. 82	23. 13
本期利润	12, 258, 921. 03	0. 29
加权平均基金份 额本期利润	0. 0551	0. 0007
本期加权平均净 值利润率	6. 54%	0. 08%
本期基金份额净 值增长率	6. 70%	6. 39%
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	-25, 939, 455. 56	-56. 61
期末可供分配基 金份额利润	-0. 1213	-0. 1271

期末基金资产净值	187,905,616.89	388.80
期末基金份额净值	0.8786	0.8729
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	-12.14%	6.39%

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、本基金自 2025 年 1 月 24 日起增设 C 类基金份额，并于 2025 年 1 月 27 日开始对 C 类份额进行估值。

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

景顺长城量化成长演化混合 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
过去一个月	4.32%	0.77%	2.48%	0.49%	1.84%	0.28%
过去三个月	2.62%	1.37%	1.38%	0.93%	1.24%	0.44%
过去六个月	6.70%	1.29%	1.04%	0.86%	5.66%	0.43%
过去一年	23.97%	1.60%	13.57%	1.15%	10.40%	0.45%
过去三年	-1.14%	1.23%	-5.72%	0.90%	4.58%	0.33%
自基金合同生效起至今	-12.14%	1.23%	-8.54%	0.92%	-3.60%	0.31%

景顺长城量化成长演化混合 C

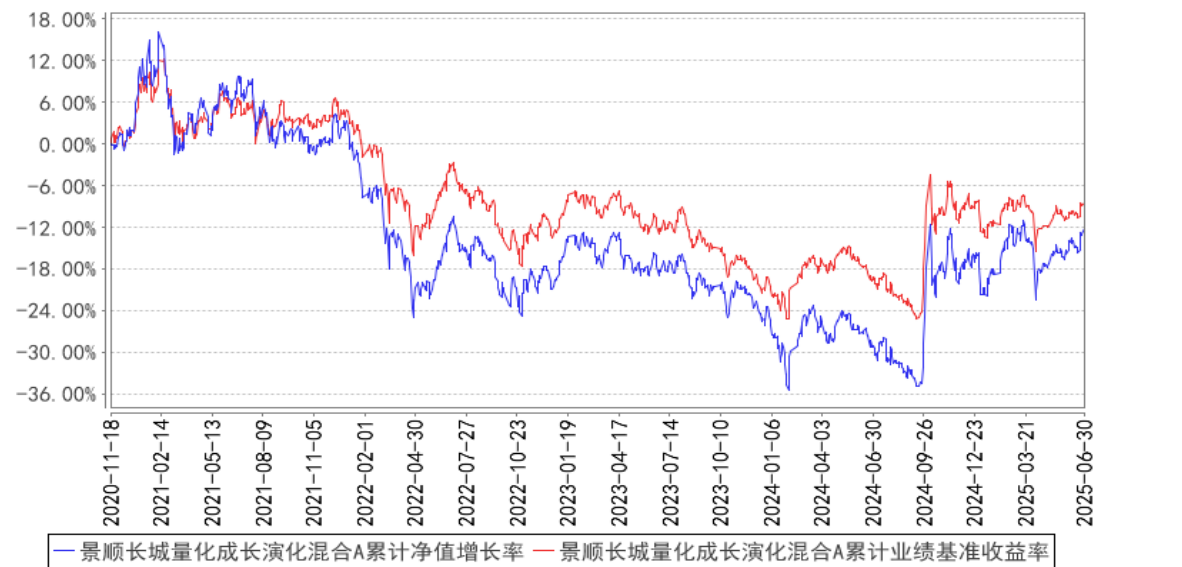
阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	4.21%	0.77%	2.48%	0.49%	1.73%	0.28%
过去三个月	2.32%	1.37%	1.38%	0.93%	0.94%	0.44%
自基金合同生效起 至今	6.39%	1.28%	2.83%	0.85%	3.56%	0.43%

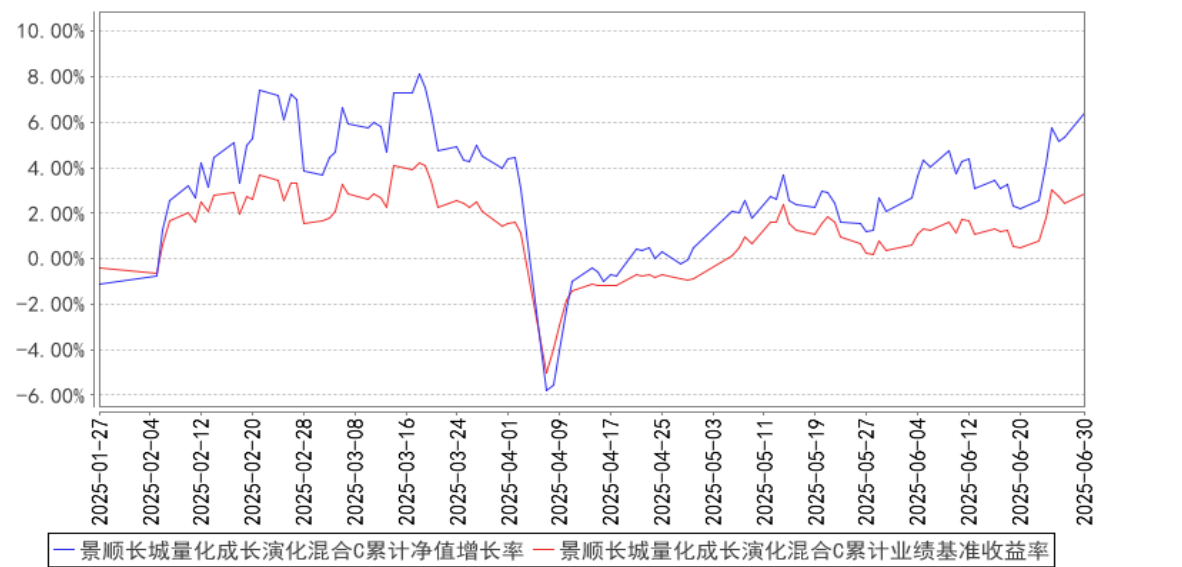
注：本基金于 2025 年 1 月 24 日增设 C 类基金份额，并于 2025 年 1 月 27 日开始对 C 类份额进行估值。

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

景顺长城量化成长演化混合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



景顺长城量化成长演化混合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：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%，其中投资于本基金界定的“成长演化”主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2020 年 11 月 18 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合均达到上述投资组合比例的要求。本基金自 2025 年 1 月 24 日起增设 C 类基金份额。

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		
徐 喻 军	本基金的基金经理	2022 年 2 月 19 日	-	15 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 15 年证券、基金行业从业经验。
王 高	本基金的	2025 年 3	-	7 年	经济学硕士。2018 年 7 月加入本公司，担

斌	基金助理	月 27 日			任量化及指数投资部研究员，现任基金经理助理。具有 7 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、《景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

2025 年上半年，宏观经济整体延续较强韧性，生产端的表现依旧强劲，需求端表现有所分化，出口在关税的冲击扰动下有所回落，消费在以旧换新政策的支持下延续亮眼表现，而投资则在二季度以来逐月降温，房地产重现新一轮下行压力，总体价格则延续低迷表现。从数据来看，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 49.0、49.5、49.7，经济景气指数呈现逐步抬升的趋势。今年前 5 个月工业增加值累计同比 6.3%，其中 5 月份工业增加值当月同比增长 5.8%，经济呈现出较强的韧性。5 月 PPI 同比下降 3.3%，环比下降 0.4%；CPI 同比下滑 0.1%，环比下降 0.2%，价格类指数整体偏

弱。5 月 M2 同比增长 7.9%，M1 同比增长 2.3%，信贷需求依然较弱；5 月末外汇储备 3.28 万亿美元，人民币汇率维持强势。整体来看，国内经济数据虽然边际有所走弱，但整体依然维持较强的韧性，经济动能的切换提升了权益市场的估值水平。上半年 A 股市场震荡上行，上证综指上涨 2.76%，沪深 300 上涨 0.03%，创业板指上涨 0.53%。

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 6.70%，业绩比较基准收益率为 1.04%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 6.39%，业绩比较基准收益率为 2.83%。

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，外需在抢出口效应退潮后可能会进一步降温回落，内需 in 补贴政策的支持下可能对经济形成一定支撑，海外环境依然面临一定的不确定性。同时随着经济动能的转换，新质生产力相关产业有望迎来快速发展，权益市场依然具有较多结构性的投资机会。个股层面相对充裕的流动性环境，市场层面相对分散的结构性行情，这对于我们量化选股模型是相对有利的。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。

本基金注重对中国经济演化趋势的研究，密切跟踪我国的产业政策，重点配置新产业政策受益较大的子行业，优先选取行业增长较快且有较大的成长空间的行业进行配置。在本基金界定的成长演化主题范围内，通过量化多因子模型精选股票，力争获取行业成长红利和个股超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估

值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，景顺长城基金管理有限公司在景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由景顺长城基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金

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	10,653,887.63	8,682,896.19
结算备付金		399,367.99	427,504.67
存出保证金		15,171.82	18,222.90
交易性金融资产	6.4.7.2	177,556,549.08	179,915,660.64
其中：股票投资		177,495,543.73	176,868,683.93
基金投资		—	—
债券投资		61,005.35	3,046,976.71
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		9,548.80	—
应收股利		—	—
应收申购款		10,446.46	3,216.18
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—
资产总计		188,644,971.78	189,047,500.58
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		—	—
应付赎回款		308,832.23	120,991.37
应付管理人报酬		182,503.95	194,559.91
应付托管费		30,417.31	32,426.66
应付销售服务费		0.30	—
应付投资顾问费		—	—
应交税费		0.22	—

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	217,212.08	182,473.74
负债合计		738,966.09	530,451.68
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	213,845,517.86	228,939,843.41
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-25,939,512.17	-40,422,794.51
净资产合计		187,906,005.69	188,517,048.90
负债和净资产总计		188,644,971.78	189,047,500.58

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 213,845,517.86 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 0.8786 元，基金份额 213,845,072.45 份；本基金 C 类份额净值人民币 0.8729 元，基金份额 445.41 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		13,640,455.94	-13,077,754.70
1. 利息收入		4,855.69	16,005.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,855.69	16,005.26
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）		13,888,244.90	-10,167,900.19
其中：股票投资收益	6.4.7.14	12,067,893.91	-11,986,150.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	21,173.44	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,799,177.55	1,818,250.72
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的		-	-

收益			
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	-255, 038. 63	-2, 926, 555. 01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	2, 393. 98	695. 24
减：二、营业总支出		1, 381, 534. 62	1, 352, 976. 91
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 113, 800. 43	1, 076, 010. 43
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	185, 633. 39	179, 335. 00
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	1. 23	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		0. 02	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	82, 099. 55	97, 631. 48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12, 258, 921. 32	-14, 430, 731. 61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12, 258, 921. 32	-14, 430, 731. 61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		12, 258, 921. 32	-14, 430, 731. 61

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金

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	净资产合计
一、上期期末净资产	228, 939, 843. 41	-	-40, 422, 794. 51	188, 517, 048. 90
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	228,939,843.41	-	-40,422,794.51	188,517,048.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-15,094,325.55	-	14,483,282.34	-611,043.21
(一)、综合收益总额	-	-	12,258,921.32	12,258,921.32
(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)	-15,094,325.55	-	2,224,361.02	-12,869,964.53
其中：1. 基金申购款	2,023,952.87	-	-335,938.88	1,688,013.99
2. 基金赎回款	-17,118,278.42	-	2,560,299.90	-14,557,978.52
(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	213,845,517.86	-	-25,939,512.17	187,906,005.69
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	253,538,096.58	-	-59,314,202.27	194,223,894.31
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	253,538,096.58	-	-59,314,202.27	194,223,894.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-11,148,899.61	-	-11,274,046.73	-22,422,946.34
(一)、综合收益总额	-	-	-14,430,731.61	-14,430,731.61

(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)	-11,148,899.61	-	3,156,684.88	-7,992,214.73
其中：1. 基金申购款	1,186,244.11	-	-318,399.39	867,844.72
2. 基金赎回款	-12,335,143.72	-	3,475,084.27	-8,860,059.45
(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	242,389,196.97	-	-70,588,249.00	171,800,947.97

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

景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]1620号《关于准予景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金注册的批复》核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,147,379,251.65元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0968号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金基金合同》于2020年11月18日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,147,713,112.19份基金份额，其中认购资金利息折合333,860.54份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基

金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、股指期货、国债期货、股票期权、债券（包括但不限于国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据法律法规的规定参与融资业务。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%，其中投资于本基金界定的“成长演化”主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%

根据本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2025 年 1 月 24 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同、托管协议部分条款的公告》，自 2025 年 1 月 24 日起，本基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。根据更新后的《景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金基金合同》，本基金根据申购费用、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的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。

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信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编

报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(1) 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。

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	10,653,887.63
等于：本金	10,653,751.68
加：应计利息	135.95
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	10,653,887.63

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		171,313,948.91	-	177,495,543.73	6,181,594.82
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	61,000.00	5.35	61,005.35	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	61,000.00	5.35	61,005.35	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		171,374,948.91	5.35	177,556,549.08	6,181,594.82

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

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.55
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	141,303.41
其中：交易所市场	141,303.41
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	75,908.12
合计	217,212.08

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城量化成长演化混合 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	228,939,843.41	228,939,843.41
本期申购	2,022,745.38	2,022,745.38
本期赎回（以“-”号填列）	-17,117,516.34	-17,117,516.34
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	213,845,072.45	213,845,072.45
-----	----------------	----------------

景顺长城量化成长演化混合 C

项目	本期	
	2025 年 1 月 27 日（C 类份额首个估值日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	1,207.49	1,207.49
本期赎回（以“-”号填列）	-762.08	-762.08
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	445.41	445.41

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城量化成长演化混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-30,822,912.30	-9,599,882.21	-40,422,794.51
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-30,822,912.30	-9,599,882.21	-40,422,794.51
本期利润	12,513,936.82	-255,015.79	12,258,921.03
本期基金份额交易产生的变动数	1,477,818.06	746,599.86	2,224,417.92
其中：基金申购款	-229,197.78	-106,562.26	-335,760.04
基金赎回款	1,707,015.84	853,162.12	2,560,177.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,831,157.42	-9,108,298.14	-25,939,455.56

景顺长城量化成长演化混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	23.13	-22.84	0.29
本期基金份额交易产	-60.93	4.03	-56.90

生的变动数			
其中：基金申购款	-139.72	-39.12	-178.84
基金赎回款	78.79	43.15	121.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-37.80	-18.81	-56.61

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	3,560.90
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	1,265.51
其他	29.28
合计	4,855.69

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	12,067,893.91
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	12,067,893.91

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	298,055,170.69
减：卖出股票成本总额	285,535,297.43
减：交易费用	451,979.35
买卖股票差价收入	12,067,893.91

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	27,137.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,964.35
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	21,173.44

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	3,190,560.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,136,510.00
减：应计利息总额	60,009.36
减：交易费用	5.03
买卖债券差价收入	-5,964.35

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,799,177.55
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	1,799,177.55

6.4.7.20 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	-255,038.63
股票投资	-276,848.63
债券投资	21,810.00
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	-255,038.63

6.4.7.21 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	2,316.51
基金转换费收入	77.47
合计	2,393.98

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	11,900.75
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	9,000.00

银行划款手续费	1,691.43
合计	82,099.55

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间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	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,113,800.43	1,076,010.43
其中：应支付销售机构的客户维护费	476,279.91	415,000.95
应支付基金管理人的净管理费	637,520.52	661,009.48

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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/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	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	185,633.39	179,335.00

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

日托管费=前一日基金资产净值×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		
	景顺长城量化成长演化混合 A	景顺长城量化成长演化混合 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	1.04	1.04
交通银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	1.04	1.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城量化成长演化混合 A	景顺长城量化成长演化混合 C	合计
-	-	-	-
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：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.60%/当年天数。

(2) 自 2025 年 1 月 24 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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期	10,653,887.63	3,560.90	11,939,110.43	11,118.11

注: 本基金的活期银行存款由基金托管人保管, 并按银行间同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	531	2,814.30	7,667.64	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股流通受限	12.08	18.12	37	446.96	670.44	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	177	4,867.50	9,945.63	-
301458	钧崴电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	620	6,448.00	21,148.20	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	41.90	77.87	108	4,525.20	8,409.96	-
301479	弘景光电	2025 年 5 月 28 日	1-6 个月（含）	新股流通受限	-	77.87	43	-	3,348.41	转增股
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股流通受限	39.92	45.22	125	4,990.00	5,652.50	-

301501	恒鑫生活	2025年6月6日	1-6个月(含)	新股流通受限	-	45.22	56	-	2,532.32	转增股
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025年1月8日	6个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025年3月26日	6个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025年4月10日	6个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025年4月2日	6个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025年6月13日	6个月	新股流通受限	12.80	44.54	301	3,852.80	13,406.54	-
603014	威高血净	2025年5月12日	6个月	新股流通受限	26.50	32.68	106	2,809.00	3,464.08	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股流通受限	12.30	54.45	171	2,103.30	9,310.95	-
603120	肯	2025	6个月	新股	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-

	特催化	年4月9日		流通受限						
603202	天有为	2025年4月16日	6个月	新股流通受限	93.50	90.66	32	2,992.00	2,901.12	-
603210	泰鸿万立	2025年4月1日	6个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025年3月4日	6个月	新股流通受限	20.60	35.08	82	1,689.20	2,876.56	-
603400	华之杰	2025年6月12日	6个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025年2月25日	6个月	新股流通受限	24.18	33.32	76	1,837.68	2,532.32	-
688411	海博思创	2025年1月20日	6个月	新股流通受限	19.38	83.49	375	7,267.50	31,308.75	-
688583	思看科技	2025年1月8日	6个月	新股流通受限	33.46	79.68	175	5,855.50	13,944.00	-
688583	思看科技	2025年6月19日	1个月内(含)	新股流通受限	-	79.68	52	-	4,143.36	转增股
688757	胜科纳米	2025年3月18日	6个月	新股流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025年1月2日	6个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创	2025年6月4日	6个月	新股流通受限	47.27	124.16	168	7,941.36	20,858.88	-

	新									
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118056	路维转债	2025 年 6 月 12 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	610	61,000.00	61,005.35	-

注：以上限售股的实际流通日期以上市公司的公告为准。

6.4.12.2 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
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	11,400	335,161.92	433,770.00	-

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同责任，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的账面价值占基金净资产的比例为 0.03%（上年度末：0.00%）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要

求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	10,653,887.63	-	-	-	-	-	10,653,887.63
结算备付金	399,367.99	-	-	-	-	-	399,367.99
存出保证金	15,171.82	-	-	-	-	-	15,171.82
交易性金融资产	-	-	-	-61,005.35	177,495,543.73	177,556,549.08	
应收申购款	-	-	-	-	-	10,446.46	10,446.46
应收清算款	-	-	-	-	-	9,548.80	9,548.80
资产总计	11,068,427.44	-	-	-61,005.35	177,515,538.99	188,644,971.78	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	308,832.23	308,832.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	182,503.95	182,503.95
应付托管费	-	-	-	-	-	30,417.31	30,417.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-	0.30	0.30
应交税费	-	-	-	-	-	0.22	0.22
其他负债	-	-	-	-	-	217,212.08	217,212.08
负债总计	-	-	-	-	-	738,966.09	738,966.09
利率敏感度 缺口	11,068,427.44	-	-	-61,005.35	-	-	-
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	8,682,896.19	-	-	-	-	-	8,682,896.19
结算备付金	427,504.67	-	-	-	-	-	427,504.67
存出保证金	18,222.90	-	-	-	-	-	18,222.90
交易性金融资产	-	-3,046,976.71	-	-	-176,868,683.93	179,915,660.64	
应收申购款	-	-	-	-	-	3,216.18	3,216.18
资产总计	9,128,623.76	-3,046,976.71	-	-	-176,871,900.11	189,047,500.58	
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	120,991.37	120,991.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	194,559.91	194,559.91
应付托管费	-	-	-	-	-	32,426.66	32,426.66
其他负债	-	-	-	-	-	182,473.74	182,473.74
负债总计	-	-	-	-	-	530,451.68	530,451.68
利率敏感度缺口	9,128,623.76	-3,046,976.71	-	-	-	-	-

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	-	-3,429.33
	市场利率下降 25 个基点	-	3,435.51

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	177,495,543.73	94.46	176,868,683.93	93.82

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	177,495,543.73	94.46	176,868,683.93	93.82

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%	10,542,133.55	10,206,147.56
	沪深 300 指数下降 5%	-10,542,133.55	-10,206,147.56

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	176,796,194.25	176,074,450.43
第二层次	494,775.35	3,629,627.31
第三层次	265,579.48	211,582.90

合计	177,556,549.08	179,915,660.64
----	----------------	----------------

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	177,495,543.73	94.09
	其中：股票	177,495,543.73	94.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	61,005.35	0.03
	其中：债券	61,005.35	0.03
	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	11,053,255.62	5.86
8	其他各项资产	35,167.08	0.02
9	合计	188,644,971.78	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	418,110.00	0.22
C	制造业	122,977,233.97	65.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	831,077.00	0.44
E	建筑业	69,920.00	0.04
F	批发和零售业	2,616,532.00	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	1,157,369.00	0.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,613,429.24	8.84
J	金融业	22,441,418.98	11.94
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	318,710.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	6,501,449.54	3.46
N	水利、环境和公共设施管理业	358,688.00	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	237,150.00	0.13
Q	卫生和社会工作	1,875,402.00	1.00
R	文化、体育和娱乐业	1,079,054.00	0.57
S	综合	-	-
	合计	177,495,543.73	94.46

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	5,600	7,893,312.00	4.20
2	601318	中国平安	119,851	6,649,333.48	3.54
3	600276	恒瑞医药	88,100	4,572,390.00	2.43
4	603259	药明康德	49,556	3,446,619.80	1.83
5	000725	京东方 A	838,300	3,344,817.00	1.78
6	600887	伊利股份	114,700	3,197,836.00	1.70
7	000651	格力电器	70,100	3,148,892.00	1.68
8	002475	立讯精密	87,700	3,042,313.00	1.62
9	601211	国泰海通	156,700	3,002,372.00	1.60
10	000333	美的集团	37,300	2,693,060.00	1.43
11	603501	豪威集团	20,000	2,553,000.00	1.36
12	002001	新 和 成	109,600	2,331,192.00	1.24
13	000776	广发证券	137,000	2,302,970.00	1.23

14	000977	浪潮信息	43,500	2,213,280.00	1.18
15	688008	澜起科技	24,393	2,000,226.00	1.06
16	688012	中微公司	10,900	1,987,070.00	1.06
17	600584	长电科技	58,300	1,964,127.00	1.05
18	300369	绿盟科技	251,300	1,952,601.00	1.04
19	688256	寒武纪	2,900	1,744,350.00	0.93
20	301080	百普赛斯	24,000	1,716,720.00	0.91
21	300476	胜宏科技	12,200	1,639,436.00	0.87
22	300408	三环集团	47,900	1,599,860.00	0.85
23	000100	TCL 科技	349,600	1,513,768.00	0.81
24	000858	五 粮 液	12,200	1,450,580.00	0.77
25	300059	东方财富	61,500	1,422,495.00	0.76
26	000783	长江证券	201,000	1,392,930.00	0.74
27	605499	东鹏饮料	4,370	1,372,398.50	0.73
28	300760	迈瑞医疗	6,000	1,348,500.00	0.72
29	601138	工业富联	62,300	1,331,974.00	0.71
30	002230	科大讯飞	27,800	1,331,064.00	0.71
31	688041	海光信息	9,000	1,271,610.00	0.68
32	603005	晶方科技	44,200	1,254,838.00	0.67
33	688981	中芯国际	13,900	1,225,563.00	0.65
34	300573	兴齐眼药	22,880	1,184,955.20	0.63
35	600030	中信证券	42,800	1,182,136.00	0.63
36	601319	中国人保	126,200	1,099,202.00	0.58
37	603893	瑞芯微	7,200	1,093,392.00	0.58
38	600690	海尔智家	44,100	1,092,798.00	0.58
39	601336	新华保险	17,900	1,047,150.00	0.56
40	300236	上海新阳	26,900	1,043,720.00	0.56
41	002415	海康威视	36,600	1,014,918.00	0.54
42	688213	思特威	9,562	977,427.64	0.52
43	603160	汇顶科技	13,500	958,905.00	0.51
44	002463	沪电股份	22,200	945,276.00	0.50
45	301031	中熔电气	11,116	885,389.40	0.47
46	002138	顺络电子	31,400	882,968.00	0.47
47	688185	康希诺	14,800	882,524.00	0.47
48	688469	芯联集成	174,500	832,365.00	0.44
49	300358	楚天科技	104,700	816,660.00	0.43
50	600867	通化东宝	99,200	813,440.00	0.43
51	688111	金山办公	2,900	812,145.00	0.43
52	601989	中国重工	174,200	808,288.00	0.43
53	605111	新洁能	25,804	793,214.96	0.42
54	300101	振芯科技	34,300	776,209.00	0.41
55	000538	云南白药	13,600	758,744.00	0.40
56	002858	力盛体育	56,600	753,912.00	0.40

57	603296	华勤技术	9,200	742,256.00	0.40
58	000034	神州数码	19,400	730,216.00	0.39
59	300363	博腾股份	42,200	720,776.00	0.38
60	603019	中科曙光	10,200	718,080.00	0.38
61	300433	蓝思科技	31,400	700,220.00	0.37
62	600809	山西汾酒	3,900	687,921.00	0.37
63	002252	上海莱士	98,700	678,069.00	0.36
64	002382	蓝帆医疗	120,900	677,040.00	0.36
65	300502	新易盛	5,240	665,584.80	0.35
66	601456	国联民生	64,300	665,505.00	0.35
67	688401	路维光电	19,000	659,300.00	0.35
68	688120	华海清科	3,900	657,930.00	0.35
69	000568	泸州老窖	5,800	657,720.00	0.35
70	300475	香农芯创	18,400	655,592.00	0.35
71	002011	盾安环境	55,700	646,120.00	0.34
72	688508	芯朋微	11,500	641,930.00	0.34
73	688608	恒玄科技	1,800	626,364.00	0.33
74	300015	爱尔眼科	50,100	625,248.00	0.33
75	300725	药石科技	15,300	592,110.00	0.32
76	603288	海天味业	15,000	583,650.00	0.31
77	000938	紫光股份	24,300	582,957.00	0.31
78	300054	鼎龙股份	20,200	579,336.00	0.31
79	603138	海量数据	39,200	565,264.00	0.30
80	601901	方正证券	69,600	550,536.00	0.29
81	601600	中国铝业	77,300	544,192.00	0.29
82	688220	翱捷科技	6,906	540,739.80	0.29
83	002841	视源股份	15,500	536,300.00	0.29
84	002920	德赛西威	4,900	500,437.00	0.27
85	600685	中船防务	18,300	497,577.00	0.26
86	603565	中谷物流	51,800	494,690.00	0.26
87	000963	华东医药	12,100	488,356.00	0.26
88	600183	生益科技	15,800	476,370.00	0.25
89	300383	光环新网	33,200	474,760.00	0.25
90	000895	双汇发展	18,800	458,908.00	0.24
91	000166	申万宏源	91,000	456,820.00	0.24
92	002734	利民股份	24,800	453,840.00	0.24
93	002080	中材科技	23,100	450,450.00	0.24
94	300223	北京君正	6,500	449,800.00	0.24
95	688392	骄成超声	6,600	449,658.00	0.24
96	688126	沪硅产业	23,800	445,536.00	0.24
97	600600	青岛啤酒	6,400	444,544.00	0.24
98	688114	华大智造	6,800	440,844.00	0.23
99	600219	南山铝业	113,500	434,705.00	0.23

100	688313	仕佳光子	11,400	433,770.00	0.23
101	688278	特宝生物	6,000	432,660.00	0.23
102	301236	软通动力	7,900	431,656.00	0.23
103	688668	鼎通科技	6,800	424,728.00	0.23
104	600535	天士力	27,100	424,115.00	0.23
105	002030	达安基因	69,800	422,290.00	0.22
106	688235	百济神州	1,800	420,552.00	0.22
107	601766	中国中车	59,200	416,768.00	0.22
108	002597	金禾实业	17,300	407,415.00	0.22
109	688131	皓元医药	8,400	406,140.00	0.22
110	300999	金龙鱼	13,700	404,561.00	0.22
111	603267	鸿远电子	8,000	402,160.00	0.21
112	600728	佳都科技	71,800	391,310.00	0.21
113	601231	环旭电子	26,400	386,232.00	0.21
114	601881	中国银河	22,300	382,445.00	0.20
115	002956	西麦食品	16,100	377,867.00	0.20
116	605016	百龙创园	18,260	376,703.80	0.20
117	002487	大金重工	11,400	375,060.00	0.20
118	688172	燕东微	19,000	373,540.00	0.20
119	300857	协创数据	4,320	371,779.20	0.20
120	600750	江中药业	16,900	368,927.00	0.20
121	688072	拓荆科技	2,400	368,904.00	0.20
122	600389	江山股份	19,700	366,420.00	0.20
123	002153	石基信息	42,300	366,318.00	0.19
124	688005	容百科技	16,400	366,048.00	0.19
125	688606	奥泰生物	5,400	362,880.00	0.19
126	601519	大智慧	35,600	362,764.00	0.19
127	002891	中宠股份	5,800	358,846.00	0.19
128	603799	华友钴业	9,600	355,392.00	0.19
129	300033	同花顺	1,300	354,913.00	0.19
130	601330	绿色动力	46,000	351,440.00	0.19
131	600131	国网信通	19,700	348,690.00	0.19
132	603612	索通发展	18,900	347,382.00	0.18
133	688578	艾力斯	3,700	344,248.00	0.18
134	600160	巨化股份	12,000	344,160.00	0.18
135	000893	亚钾国际	11,400	343,596.00	0.18
136	002429	兆驰股份	77,900	341,202.00	0.18
137	300990	同飞股份	6,800	339,320.00	0.18
138	002595	豪迈科技	5,700	337,554.00	0.18
139	300702	天宇股份	14,400	334,944.00	0.18
140	300824	北鼎股份	27,700	330,461.00	0.18
141	603156	养元饮品	15,600	330,096.00	0.18
142	000521	长虹美菱	47,400	328,956.00	0.18

143	688270	臻镭科技	7,000	325,920.00	0.17
144	603707	健友股份	29,200	325,580.00	0.17
145	000719	中原传媒	26,200	325,142.00	0.17
146	600012	皖通高速	19,100	324,318.00	0.17
147	002284	亚太股份	29,300	323,765.00	0.17
148	300244	迪安诊断	21,700	323,330.00	0.17
149	002293	罗莱生活	36,900	322,506.00	0.17
150	002916	深南电路	2,990	322,351.90	0.17
151	600873	梅花生物	30,100	321,769.00	0.17
152	603766	隆鑫通用	25,200	321,552.00	0.17
153	688343	云天励飞	6,500	321,230.00	0.17
154	300777	中简科技	8,800	319,000.00	0.17
155	601083	锦江航运	28,700	318,857.00	0.17
156	002050	三花智控	12,000	316,560.00	0.17
157	600489	中金黄金	21,600	316,008.00	0.17
158	600877	电科芯片	24,900	315,732.00	0.17
159	688085	三友医疗	16,400	315,372.00	0.17
160	300219	鸿利智汇	46,900	315,168.00	0.17
161	300113	顺网科技	15,900	314,184.00	0.17
162	300454	深信服	3,300	310,794.00	0.17
163	002063	远光软件	52,100	309,995.00	0.16
164	300406	九强生物	21,900	309,885.00	0.16
165	300229	拓尔思	16,800	309,792.00	0.16
166	002185	华天科技	30,500	308,050.00	0.16
167	002273	水晶光电	15,400	307,538.00	0.16
168	000727	冠捷科技	126,500	307,395.00	0.16
169	301498	乖宝宠物	2,800	306,236.00	0.16
170	600662	外服控股	59,900	306,089.00	0.16
171	300497	富祥药业	33,900	304,761.00	0.16
172	300735	光弘科技	12,100	303,710.00	0.16
173	600100	同方股份	41,100	297,564.00	0.16
174	002299	圣农发展	20,600	294,374.00	0.16
175	002032	苏泊尔	5,600	293,384.00	0.16
176	603380	易德龙	10,900	289,940.00	0.15
177	002156	通富微电	11,300	289,506.00	0.15
178	601991	大唐发电	90,800	287,836.00	0.15
179	603166	福达股份	18,600	287,742.00	0.15
180	300017	网宿科技	26,800	287,296.00	0.15
181	000813	德展健康	88,800	285,936.00	0.15
182	600011	华能国际	39,900	284,886.00	0.15
183	003006	百亚股份	10,300	282,014.00	0.15
184	600429	三元股份	62,500	281,875.00	0.15
185	600918	中泰证券	43,800	281,634.00	0.15

186	600085	同仁堂	7,800	281,268.00	0.15
187	688197	首药控股	7,700	278,740.00	0.15
188	688352	顾中科技	24,800	278,504.00	0.15
189	603882	金域医学	9,700	277,032.00	0.15
190	002219	新里程	125,800	276,760.00	0.15
191	300296	利亚德	45,300	276,330.00	0.15
192	002728	特一药业	32,300	271,643.00	0.14
193	600460	士兰微	10,700	265,574.00	0.14
194	300888	稳健医疗	6,400	263,040.00	0.14
195	601601	中国太保	7,000	262,570.00	0.14
196	301061	匠心家居	3,380	262,085.20	0.14
197	002568	百润股份	10,200	261,222.00	0.14
198	000039	中集集团	32,900	258,594.00	0.14
199	600707	彩虹股份	39,700	256,462.00	0.14
200	603939	益丰药房	10,400	254,488.00	0.14
201	300212	易华录	11,600	252,416.00	0.13
202	002180	纳思达	11,000	252,340.00	0.13
203	300496	中科创达	4,400	251,768.00	0.13
204	002600	领益智造	29,300	251,687.00	0.13
205	000021	深科技	13,300	249,242.00	0.13
206	603228	景旺电子	5,900	246,856.00	0.13
207	300285	国瓷材料	14,000	242,900.00	0.13
208	000423	东阿阿胶	4,600	240,580.00	0.13
209	002607	中公教育	77,500	237,150.00	0.13
210	002405	四维图新	27,700	236,558.00	0.13
211	300166	东方国信	21,700	236,530.00	0.13
212	300168	万达信息	30,700	235,469.00	0.13
213	600025	华能水电	24,500	233,975.00	0.12
214	001338	永顺泰	19,600	233,632.00	0.12
215	002241	歌尔股份	10,000	233,200.00	0.12
216	688095	福昕软件	3,200	217,312.00	0.12
217	600298	安琪酵母	6,100	214,537.00	0.11
218	688768	容知日新	4,777	212,051.03	0.11
219	002044	美年健康	40,500	208,170.00	0.11
220	688475	萤石网络	6,600	208,032.00	0.11
221	002099	海翔药业	37,600	206,800.00	0.11
222	688696	极米科技	1,800	205,848.00	0.11
223	300525	博思软件	14,000	203,840.00	0.11
224	601628	中国人寿	4,900	201,831.00	0.11
225	000921	海信家电	7,800	200,460.00	0.11
226	603858	步长制药	12,200	198,128.00	0.11
227	688315	诺禾致源	13,700	193,444.00	0.10
228	002286	保龄宝	16,900	191,477.00	0.10

229	300267	尔康制药	60,700	190,598.00	0.10
230	000404	长虹华意	26,700	189,570.00	0.10
231	688023	安恒信息	3,300	187,242.00	0.10
232	688031	星环科技	4,000	186,520.00	0.10
233	688617	惠泰医疗	615	182,655.00	0.10
234	601939	建设银行	19,300	182,192.00	0.10
235	002371	北方华创	400	176,884.00	0.09
236	300319	麦捷科技	16,200	173,988.00	0.09
237	002236	大华股份	10,900	173,092.00	0.09
238	688200	华峰测控	1,200	173,040.00	0.09
239	000028	国药一致	6,900	172,017.00	0.09
240	300602	飞荣达	8,000	169,680.00	0.09
241	600864	哈投股份	28,000	167,160.00	0.09
242	301267	华夏眼科	8,600	164,862.00	0.09
243	002847	盐津铺子	2,000	160,800.00	0.09
244	300079	数码视讯	26,600	155,610.00	0.08
245	300623	捷捷微电	5,200	154,960.00	0.08
246	300088	长信科技	25,900	154,364.00	0.08
247	688536	思瑞浦	1,100	152,592.00	0.08
248	000050	深天马 A	17,400	148,248.00	0.08
248	002390	信邦制药	42,600	148,248.00	0.08
249	600958	东方证券	14,600	141,328.00	0.08
250	002821	凯莱英	1,600	141,200.00	0.08
251	603179	新泉股份	2,900	136,213.00	0.07
252	002345	潮宏基	9,000	131,670.00	0.07
253	000988	华工科技	2,800	131,628.00	0.07
254	603087	甘李药业	2,400	131,472.00	0.07
255	688188	柏楚电子	980	129,026.80	0.07
256	002351	漫步者	9,500	124,640.00	0.07
257	300373	扬杰科技	2,400	124,560.00	0.07
258	603290	斯达半导	1,500	121,905.00	0.06
259	603697	有友食品	9,100	120,029.00	0.06
260	600436	片仔癀	600	120,006.00	0.06
261	300146	汤臣倍健	10,600	119,144.00	0.06
262	000623	吉林敖东	7,000	118,650.00	0.06
263	300684	中石科技	4,900	117,012.00	0.06
264	002484	江海股份	5,700	116,793.00	0.06
265	600845	宝信软件	4,500	106,290.00	0.06
266	601688	华泰证券	5,900	105,079.00	0.06
267	600062	华润双鹤	5,600	104,496.00	0.06
268	688678	福立旺	5,400	102,816.00	0.05
269	603678	火炬电子	2,700	102,681.00	0.05
270	002155	湖南黄金	5,720	102,102.00	0.05

271	002315	焦点科技	2,200	100,518.00	0.05
272	002585	双星新材	18,200	99,372.00	0.05
273	603171	税友股份	2,300	98,693.00	0.05
274	000823	超声电子	8,300	98,355.00	0.05
275	688739	成大生物	3,700	97,680.00	0.05
276	300973	立高食品	2,000	97,540.00	0.05
277	688088	虹软科技	2,000	96,500.00	0.05
278	688146	中船特气	3,300	95,403.00	0.05
279	688259	创耀科技	2,400	95,160.00	0.05
280	601127	赛力斯	700	94,024.00	0.05
281	600703	三安光电	7,500	93,150.00	0.05
282	000001	平安银行	7,700	92,939.00	0.05
283	688138	清溢光电	3,400	92,446.00	0.05
284	002065	东华软件	9,600	92,160.00	0.05
285	688380	中微半导	3,400	92,140.00	0.05
286	600713	南京医药	17,900	90,574.00	0.05
287	600216	浙江医药	6,100	90,219.00	0.05
288	600305	恒顺醋业	11,600	89,668.00	0.05
289	605507	国邦医药	4,500	88,965.00	0.05
290	300009	安科生物	10,600	88,722.00	0.05
291	688336	三生国健	1,626	88,194.24	0.05
292	688208	道通科技	2,880	88,128.00	0.05
293	600572	康恩贝	20,100	88,038.00	0.05
294	603297	永新光学	1,000	87,350.00	0.05
295	600563	法拉电子	800	87,272.00	0.05
296	688052	纳芯微	500	87,245.00	0.05
297	600850	电科数字	3,600	87,084.00	0.05
298	600732	爱旭股份	6,600	86,460.00	0.05
299	688258	卓易信息	1,700	82,331.00	0.04
300	688198	佰仁医疗	800	82,152.00	0.04
301	688153	唯捷创芯	2,600	80,626.00	0.04
302	688026	洁特生物	4,900	80,360.00	0.04
303	603868	飞科电器	2,200	78,914.00	0.04
304	300768	迪普科技	4,500	77,175.00	0.04
305	603636	南威软件	6,100	77,104.00	0.04
306	002988	豪美新材	2,000	76,000.00	0.04
307	002624	完美世界	4,900	74,333.00	0.04
308	688318	财富趋势	640	73,548.80	0.04
309	688372	伟测科技	1,213	73,265.20	0.04
310	600491	龙元建设	19,000	69,920.00	0.04
311	000729	燕京啤酒	5,100	65,943.00	0.04
312	002410	广联达	4,800	64,368.00	0.03
313	300782	卓胜微	900	64,233.00	0.03

314	300559	佳发教育	5,400	63,720.00	0.03
315	688787	海天瑞声	600	63,708.00	0.03
316	603989	艾华集团	4,100	63,140.00	0.03
317	300869	康泰医学	4,400	63,096.00	0.03
318	300803	指南针	775	62,511.50	0.03
319	300339	润和软件	1,100	55,913.00	0.03
320	688206	概伦电子	1,900	55,252.00	0.03
321	688029	南微医学	800	54,040.00	0.03
322	603486	科沃斯	900	52,407.00	0.03
323	600418	江淮汽车	1,300	52,117.00	0.03
324	600332	白云山	1,900	50,084.00	0.03
325	600479	千金药业	4,800	49,920.00	0.03
326	002993	奥海科技	1,200	49,764.00	0.03
327	300253	卫宁健康	4,500	47,700.00	0.03
328	301047	义翘神州	700	47,670.00	0.03
329	688575	亚辉龙	3,200	46,688.00	0.02
330	688515	裕太微	500	45,800.00	0.02
331	002926	华西证券	5,000	44,700.00	0.02
332	603039	泛微网络	800	44,560.00	0.02
333	688368	晶丰明源	500	43,915.00	0.02
334	688002	睿创微纳	600	41,832.00	0.02
335	688351	微电生理	2,000	39,400.00	0.02
336	600751	海航科技	11,800	38,704.00	0.02
337	603011	合锻智能	2,100	32,718.00	0.02
338	300232	洲明科技	4,500	32,580.00	0.02
339	688411	海博思创	375	31,308.75	0.02
340	300162	雷曼光电	4,100	31,160.00	0.02
341	000661	长春高新	300	29,754.00	0.02
342	300655	晶瑞电材	2,900	29,029.00	0.02
343	688286	敏芯股份	400	28,276.00	0.02
344	601099	太平洋	7,100	27,903.00	0.01
345	301367	瑞迈特	300	25,230.00	0.01
346	600770	综艺股份	4,600	24,380.00	0.01
347	603233	大参林	1,400	22,820.00	0.01
348	301458	钧崴电子	620	21,148.20	0.01
349	688775	影石创新	168	20,858.88	0.01
350	600171	上海贝岭	600	20,550.00	0.01
351	002352	顺丰控股	400	19,504.00	0.01
352	600285	羚锐制药	800	18,136.00	0.01
353	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
354	688001	华兴源创	600	15,162.00	0.01
355	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01
356	301678	新恒汇	301	13,406.54	0.01

357	000829	天音控股	1,300	13,273.00	0.01
358	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.01
359	002489	浙江永强	3,600	13,176.00	0.01
360	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.01
361	301479	弘景光电	151	11,758.37	0.01
362	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
363	300996	普联软件	700	10,521.00	0.01
364	301658	首航新能	437	10,042.26	0.01
365	301275	汉朔科技	177	9,945.63	0.01
366	600861	北京人力	500	9,650.00	0.01
367	603072	天和磁材	171	9,310.95	0.00
368	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
369	301501	恒鑫生活	181	8,184.82	0.00
370	301326	捷邦科技	100	7,974.00	0.00
371	002436	兴森科技	600	7,944.00	0.00
372	001356	富岭股份	531	7,667.64	0.00
373	688209	英集芯	400	7,388.00	0.00
374	603199	九华旅游	200	7,248.00	0.00
375	300456	赛微电子	400	6,876.00	0.00
376	688039	当虹科技	200	6,564.00	0.00
377	002745	木林森	800	6,304.00	0.00
378	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
379	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
380	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
381	600536	中国软件	100	4,677.00	0.00
382	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
383	688289	圣湘生物	200	4,096.00	0.00
384	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
385	603014	威高血净	106	3,464.08	0.00
386	300662	科锐国际	100	2,971.00	0.00
387	603202	天有为	32	2,901.12	0.00
388	603271	永杰新材	82	2,876.56	0.00
389	603409	汇通控股	76	2,532.32	0.00
390	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
391	300287	飞利信	400	2,300.00	0.00
392	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
393	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
394	001390	古麒绒材	37	670.44	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	300476	胜宏科技	3,489,155.00	1.85
2	600887	伊利股份	3,263,387.00	1.73
3	688981	中芯国际	2,560,441.22	1.36
4	300059	东方财富	2,188,577.00	1.16
5	601211	国泰海通	2,064,857.00	1.10
6	688041	海光信息	2,002,614.34	1.06
7	300408	三环集团	1,975,931.00	1.05
8	000100	TCL 科技	1,972,933.00	1.05
9	600276	恒瑞医药	1,926,528.00	1.02
10	688256	寒武纪	1,865,620.00	0.99
11	300369	绿盟科技	1,842,064.00	0.98
12	002230	科大讯飞	1,824,224.00	0.97
13	000977	浪潮信息	1,780,513.00	0.94
14	603501	豪威集团	1,700,036.00	0.90
15	601360	三六零	1,696,310.00	0.90
16	601336	新华保险	1,669,073.00	0.89
17	600872	中炬高新	1,659,705.00	0.88
18	002550	千红制药	1,649,884.00	0.88
19	605499	东鹏饮料	1,637,829.00	0.87
20	300760	迈瑞医疗	1,632,187.00	0.87

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	603501	豪威集团	4,202,335.00	2.23
2	300476	胜宏科技	3,271,426.00	1.74
3	601318	中国平安	2,891,546.00	1.53
4	000988	华工科技	2,573,538.00	1.37
5	300433	蓝思科技	2,538,501.00	1.35
6	002550	千红制药	2,529,881.00	1.34
7	002371	北方华创	2,322,798.00	1.23
8	603087	甘李药业	2,135,238.00	1.13
9	300244	迪安诊断	2,108,486.00	1.12
10	603986	兆易创新	2,066,444.00	1.10
11	601601	中国太保	2,045,720.00	1.09
12	605499	东鹏饮料	2,019,464.00	1.07
13	000333	美的集团	2,017,099.59	1.07
14	601360	三六零	2,015,815.00	1.07
15	688981	中芯国际	2,012,843.98	1.07
16	603259	药明康德	1,983,646.00	1.05
17	300661	圣邦股份	1,979,617.00	1.05
18	601881	中国银河	1,887,512.00	1.00

19	600276	恒瑞医药	1,876,472.00	1.00
20	300529	健帆生物	1,804,921.00	0.96

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	286,439,005.86
卖出股票收入（成交）总额	298,055,170.69

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	-	-
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）	61,005.35	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	61,005.35	0.03

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	118056	路维转债	610	61,005.35	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

- 1、时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。
- 2、套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再参考基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。
- 3、合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

内蒙古伊利实业集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方市场监督管理局的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内未出现被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,171.82
2	应收清算款	9,548.80
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,446.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	—
9	合计	35,167.08

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 量化成长 演化混合 A	8,554	24,999.42	178,554.49	0.08	213,666,517.96	99.92
景顺长城 量化成长 演化混合 C	5	89.08	—	—	445.41	100.00
合计	8,559	24,984.87	178,554.49	0.08	213,666,963.37	99.92

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	景顺长城量化成长演化混合 A	118.64	0.000055
	景顺长城量化成长演化混合 C	352.94	79.239353

	合计	471.58	0.000221
--	----	--------	----------

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	景顺长城量化成长演化混合 A	景顺长城量化成长演化混合 C
基金合同生效日 (2020 年 11 月 18 日) 基金份额总额	1,147,713,112.19	—
本报告期期初基金份额总额	228,939,843.41	—
本报告期基金总申购份额	2,022,745.38	1,207.49
减：本报告期基金总赎回份额	17,117,516.34	762.08
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	213,845,072.45	445.41

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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰海通证券股份有限公司	2	269,166,399.74	46.13	122,477.60	46.13	未变更
中信建投证券股份有限公司	2	138,891,490.11	23.80	63,195.67	23.80	未变更
东吴证券股份有限公司	1	78,812,065.32	13.51	35,859.46	13.51	未变更
中信证券股份有限公司	2	66,897,518.62	11.47	30,438.37	11.46	未变更
平安证券股份有限	2	29,715,765.71	5.09	13,521.62	5.09	未变更

公司						
----	--	--	--	--	--	--

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。

10.7.2 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 (%)
国泰海通证券股份有限公司	41,020.89	31.42	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	11,517.58	8.82	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	78,021.57	59.76	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 22 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 22 日
6	景顺长城量化成长演化混合型证券投	中国证监会指定报刊及	2025 年 1 月 24 日

	资基金 2025 年第 1 号更新招募说明书	网站	
7	景顺长城量化成长演化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	2025 年 1 月 24 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江海证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 24 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同、托管协议部分条款的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 24 日
10	景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金基金合同（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 24 日
11	景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金托管协议（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 24 日
12	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
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 3 月 19 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 27 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 28 日
16	景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 28 日
17	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
18	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
19	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	2025 年 4 月 14 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 4 月 15 日
21	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
22	景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金 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
23	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
24	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
25	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

26	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
27	景顺长城量化成长演化混合型证券投 资基金 2025 年第 2 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
28	景顺长城量化成长演化混合型证券投 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	2025 年 5 月 24 日
29	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
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下 部分基金新增中国邮政储蓄银行股份 有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及 网站	2025 年 5 月 30 日
31	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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足不同类型的投资者的投资需求，根据《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》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》等法律法规的规定和《基金合同》的约定，经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，景顺长城基金管理有限公司决定自 2025 年 1 月 24 日起对本基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额，同时对《基金合同》和《托管协议》进行了相应的修改。详情请参阅本基金管理人于 2025 年 1 月 24 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同、托管协议部分条款的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金托管协议》；

- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日