

景顺长城能源基建混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城能源基建混合型证券投资基金	
基金简称	景顺长城能源基建混合	
场内简称	无	
基金主代码	260112	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 10 月 20 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,599,402,158.10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城能源基建混合 A	景顺长城能源基建混合 C
下属分级基金的交易代码	260112	017090
报告期末下属分级基金的份额总额	1,891,516,943.05 份	707,885,215.05 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过把握中国能源及基础设施建设需求带来的相关产业成长机会，实现长期资本增值。
投资策略	股票投资遵循“自下而上”与“自上而下”相结合的投资策略，寻找投资主题当中最具爆发力子行业中的龙头企业。债券投资采取利率预期策略、流动性策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上为投资者获取稳定的收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+中证全债指数×20%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，属于风险程度较高的投资品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于货币型基金与债券型基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95599
传真	0755-22381339	010-68121816
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518048	100031
法定代表人	李进	谷澍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	景顺长城能源基建混合 A	景顺长城能源基建混合 C
本期已实现收益	233,965,705.58	75,365,024.90
本期利润	354,357,359.53	37,215,083.20
加权平均基金份额本期利润	0.2275	0.0977
本期加权平均净值利润率	10.95%	4.62%
本期基金份额净值增长率	14.76%	14.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,771,518,833.53	658,624,657.91
期末可供分配基金份额利润	0.9366	0.9304
期末基金资产净值	4,043,567,121.45	1,508,796,434.14
期末基金份额净值	2.138	2.131
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	293.76%	18.45%

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三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

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

低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城能源基建混合 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	1.52%	0.50%	1.05%	0.69%	0.47%	-0.19%
过去三个月	2.44%	0.58%	-3.73%	0.66%	6.17%	-0.08%
过去六个月	14.76%	0.69%	0.05%	0.67%	14.71%	0.02%
过去一年	19.18%	0.66%	-10.66%	0.79%	29.84%	-0.13%
过去三年	51.63%	0.65%	-3.05%	0.96%	54.68%	-0.31%
自基金合同生效起至今	293.76%	1.15%	33.49%	1.13%	260.27%	0.02%

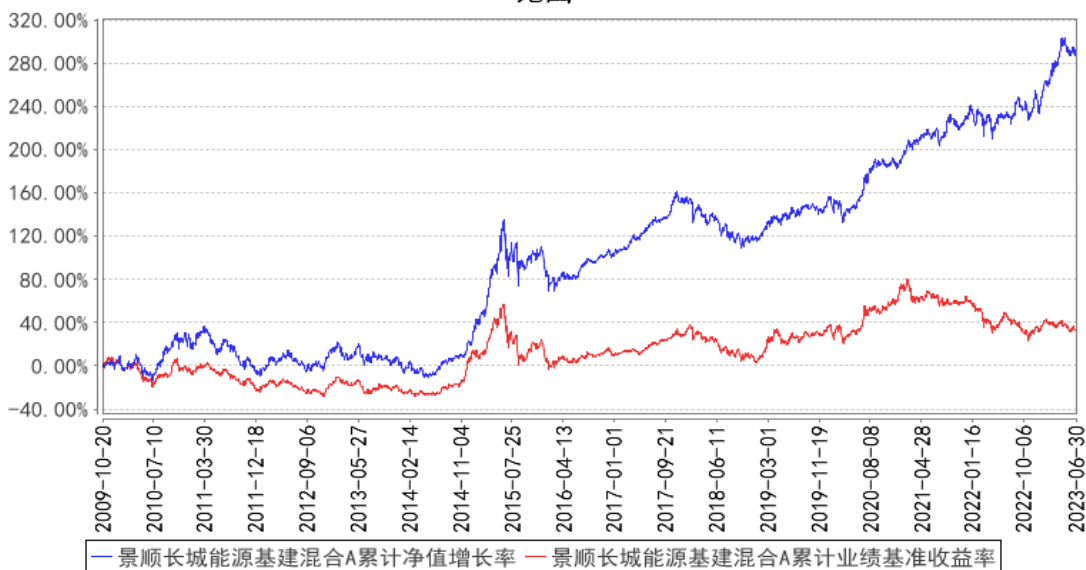
景顺长城能源基建混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.48%	0.50%	1.05%	0.69%	0.43%	-0.19%
过去三个月	2.30%	0.58%	-3.73%	0.66%	6.03%	-0.08%
过去六个月	14.51%	0.69%	0.05%	0.67%	14.46%	0.02%
自基金合同生效起至今	18.45%	0.70%	4.16%	0.73%	14.29%	-0.03%

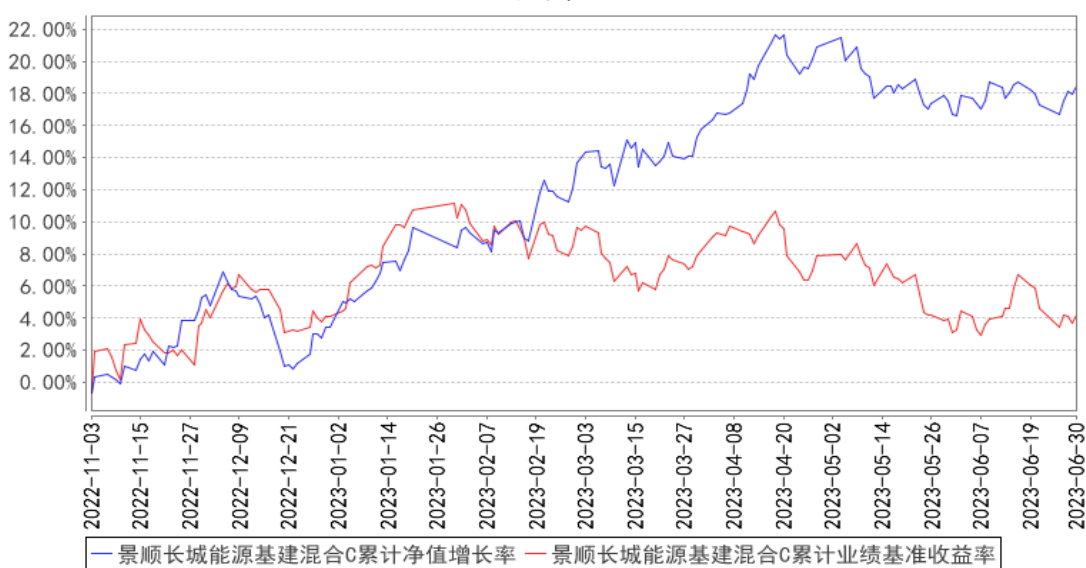
注：本基金于 2022 年 11 月 2 日增设 C 类基金份额，并于 2022 年 11 月 3 日开始对 C 类份额进行估值。

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

景顺长城能源基建混合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



景顺长城能源基建混合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：本基金的资产配置比例为：股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于与能源及基建业务相关的上市公司所发行股票的比例高于基金股票投资的 80%。根据基金合同的规定，本基金的建仓期为基金合同生效日（2009 年 10 月 20 日）起六个月。建仓期结束时，本基金投资组合比例达到上述投资组合比例的要求。本基金自 2022 年 11 月 2 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2023年6月30日，本公司旗下共管理175只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
鲍无可	本基金的基金经理	2014年6月27日	-	15年	工学硕士。曾任平安证券有限责任公司综合研究所行业研究员。2009年12月加入本公司，历任研究部研究员、高级研究员，自2014年6月起担任股票投资部基金经理，现任股票投资部总监、基金经理。具有15年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 17 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

截至撰写半年报时，我们依然没有找到需要和持有人沟通的长期话题，故此次我们还是重点讨论上半年本基金的投资策略和运作分析。上半年，国内经济温和复苏，房地产销售面积不及预期。欧美经济表现强于预期，在较高的利率环境下，4 月份美国新屋销量实现正增长。

上半年，A 股市场最热门的方向仍是人工智能。去年底以来，ChatGPT 的横空出世是重大事件，其重要性不亚于上世纪九十年代互联网的出现。从长期来看，AI 的发展可能会在未来几十年重塑各个行业，甚至可能颠覆当前的世界格局。那些能够把握住 AI 机会的公司，将有望挑战现有的行业格局，同时，这也将导致企业之间的竞争变得更加不可测。当下是 AI 发展的初期，中国企业处于落后的位置，无论是 AI 核心模型的研发、新型商业模式的迭代以及底层芯片的制造，我们都希望国内企业能在不远的将来迎头赶上。

受益于 AI 的热度，本基金部分持仓在二季度大幅上涨，估值水平也随之提升，安全边际有所下降，我们在较高的位置获利了结，因此，本基金的总体仓位有所下降，其余持仓变化不大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年上半年，景顺长城能源基建混合 A 类份额净值增长率为 14.76%，业绩比较基准收益率为 0.05%。

2023 年上半年，景顺长城能源基建混合 C 类份额净值增长率为 14.51%，业绩比较基准收益率为 0.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，国际地缘政治的风险、居民较高的杠杆率以及国内人口老龄化或仍将是今后较长时间内的主要矛盾。但根据我们在 2021 年中期报告中的观点，我们认为持有现金并不是最佳的应对方法，长期持有股票或是更好的选择。当前全球总需求仍在稳定增长，一批优质的中国企业正在一些高价值行业进行全球扩张，我们已经看到这些主线中蕴含的投资机会。如果能找到更多合适的投资机会，本基金的仓位也将作相应提升。当前，本基金持有的上市公司均具有极高或较高的壁垒，且估值合理或偏低，我们相信这些公司有能力和能力创造长期持续的回报。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—景顺长城基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：景顺长城能源基建混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	791,306,632.68	160,033,773.11
结算备付金		5,515,738.37	2,443,027.19

存出保证金		820,472.35	256,608.93
交易性金融资产	6.4.7.2	4,769,530,562.06	2,225,943,986.84
其中：股票投资		3,961,077,959.32	2,033,174,096.43
基金投资		-	-
债券投资		808,452,602.74	192,769,890.41
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		22,964.50	322,589.71
应收股利		-	-
应收申购款		9,878,468.66	4,216,876.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		5,577,074,838.62	2,393,216,862.52
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		12,758,093.74	1,310,635.14
应付管理人报酬		6,854,943.20	2,928,780.81
应付托管费		1,142,490.55	488,130.12
应付销售服务费		499,048.89	38,440.44
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	3,456,706.65	1,334,276.42
负债合计		24,711,283.03	6,100,262.93
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,599,402,158.10	1,281,648,634.68
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,952,961,397.49	1,105,467,964.91

净资产合计		5,552,363,555.59	2,387,116,599.59
负债和净资产总计		5,577,074,838.62	2,393,216,862.52

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，景顺长城能源基建混合型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 2.138 元，景顺长城能源基建混合型证券投资基金 C 类基金份额净值人民币 2.131 元，基金份额总额 2,599,402,158.10 份，其中景顺长城能源基建混合型证券投资基金 A 类基金份额 1,891,516,943.05 份；景顺长城能源基建混合型证券投资基金 C 类基金份额 707,885,215.05 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城能源基建混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		428,170,207.31	-14,808,590.63
1. 利息收入		2,558,326.04	1,820,647.06
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,558,326.04	1,762,247.74
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		-	58,399.32
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		341,243,055.09	11,113,428.55
其中：股票投资收益	6.4.7.14	257,334,207.05	-4,178,823.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,401,418.05	1,231,040.28
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	82,507,429.99	14,061,211.96
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	82,241,712.25	-28,194,830.48
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, 127, 113. 93	452, 164. 24
减：二、营业总支出		36, 597, 764. 58	13, 559, 682. 56
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	29, 893, 405. 24	11, 512, 573. 65
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	4, 982, 234. 24	1, 918, 762. 29
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	1, 580, 177. 66	-
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		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	141, 947. 44	128, 346. 62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		391, 572, 442. 73	-28, 368, 273. 19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		391, 572, 442. 73	-28, 368, 273. 19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		391, 572, 442. 73	-28, 368, 273. 19

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城能源基建混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1, 281, 648, 634. 68	-	1, 105, 467, 964. 91	2, 387, 116, 599. 59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1, 281, 648, 634. 68	-	1, 105, 467, 964. 91	2, 387, 116, 599. 59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1, 317, 753, 523. 42	-	1, 847, 493, 432. 58	3, 165, 246, 956. 00
（一）、综合收益总额	-	-	391, 572, 442. 73	391, 572, 442. 73

(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	1,317,753,523.42	-	1,455,920,989.85	2,773,674,513.27
其中: 1. 基金申购款	2,153,035,707.28	-	2,345,858,621.98	4,498,894,329.26
2. 基金赎回款	-835,282,183.86	-	-889,937,632.13	-1,725,219,815.99
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,599,402,158.10	-	2,952,961,397.49	5,552,363,555.59
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	586,772,350.98	-	494,939,597.07	1,081,711,948.05
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	586,772,350.98	-	494,939,597.07	1,081,711,948.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	454,838,807.66	-	331,687,234.70	786,526,042.36
(一)、综合收益总额	-	-	-28,368,273.19	-28,368,273.19
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	454,838,807.66	-	360,055,507.89	814,894,315.55
其中: 1. 基金申购款	653,445,880.43	-	513,868,101.37	1,167,313,981.80
2. 基金赎回款	-198,607,072.77	-	-153,812,593.48	-352,419,666.25

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,041,611,158.64	-	826,626,831.77	1,868,237,990.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城能源基建混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），原名景顺长城能源基建股票型证券投资基金，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]759号文《关于核准景顺长城能源基建股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城能源基建股票型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2009 年 10 月 20 日生效，首次设立募集规模为 934,032,709.53 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据 2014 年 8 月 8 日施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会令第 104 号）第三十条第一项的规定，股票基金的股票资产投资比例下限由 60%上调至 80%，景顺长城基金管理有限公司经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，自 2015 年 8 月 7 日起将景顺长城能源基建股票型证券投资基金变更为本基金。

根据法律法规的规定及《景顺长城能源基建混合型证券投资基金基金合同》和《景顺长城能源基建混合型证券投资基金招募说明书》的约定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2022 年 11 月 2 日起对景顺长城能源基建混合型证券投资基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费；

C 类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的公司股票（包括存托凭证）和债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

本基金股票投资比例范围为基金资产的 60-95%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例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。本基金投资于与能源及基建业务相关的上市公司所发行股票的比例高于基金股票投资的 80%。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×80%+中证全债指数×20%。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 增值税及附加

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基

金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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

(3) 企业所得税

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

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

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

(4) 个人所得税

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	791,306,632.68
等于：本金	791,153,005.24
加：应计利息	153,627.44
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1 个月（含）-3 个月	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	791,306,632.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	3,798,785,475.96	-	3,961,077,959.32	162,292,483.36	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	799,619,980.00	8,932,602.74	808,452,602.74	-99,980.00
	合计	799,619,980.00	8,932,602.74	808,452,602.74	-99,980.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	4,598,405,455.96	8,932,602.74	4,769,530,562.06	162,192,503.36	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末的买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	31,191.01
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,307,419.70
其中：交易所市场	3,304,069.70
银行间市场	3,350.00
应付利息	-
预提费用	118,095.94
合计	3,456,706.65

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城能源基建混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,228,149,947.86	1,228,149,947.86
本期申购	1,343,730,387.96	1,343,730,387.96
本期赎回（以“-”号填列）	-680,363,392.77	-680,363,392.77
本期末	1,891,516,943.05	1,891,516,943.05

景顺长城能源基建混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	53,498,686.82	53,498,686.82
本期申购	809,305,319.32	809,305,319.32
本期赎回（以“-”号填列）	-154,918,791.09	-154,918,791.09
本期末	707,885,215.05	707,885,215.05

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

景顺长城能源基建混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	981,893,786.46	77,527,610.36	1,059,421,396.82
本期利润	233,965,705.58	120,391,653.95	354,357,359.53
本期基金份额交易产生的变动数	555,659,341.49	182,612,080.56	738,271,422.05
其中：基金申购款	1,132,054,568.09	327,796,295.55	1,459,850,863.64
基金赎回款	-576,395,226.60	-145,184,214.99	-721,579,441.59

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,771,518,833.53	380,531,344.87	2,152,050,178.40

景顺长城能源基建混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	42,671,471.73	3,375,096.36	46,046,568.09
本期利润	75,365,024.90	-38,149,941.70	37,215,083.20
本期基金份额交易产生的变动数	540,588,161.28	177,061,406.52	717,649,567.80
其中：基金申购款	676,602,883.27	209,404,875.07	886,007,758.34
基金赎回款	-136,014,721.99	-32,343,468.55	-168,358,190.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	658,624,657.91	142,286,561.18	800,911,219.09

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	2,518,095.60
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	36,188.24
其他	4,042.20
合计	2,558,326.04

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	257,334,207.05
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	257,334,207.05

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	1,926,994,865.86
减：卖出股票成本总额	1,662,254,534.17
减：交易费用	7,406,124.64
买卖股票差价收入	257,334,207.05

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,506,698.64
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-105,280.59
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,401,418.05

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	193,685,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	190,101,930.59
减：应计利息总额	3,685,000.00
减：交易费用	3,350.00
买卖债券差价收入	-105,280.59

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	82,507,429.99
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	82,507,429.99

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	82,241,712.25
股票投资	82,162,761.66
债券投资	78,950.59
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	82,241,712.25

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	1,996,776.98
基金转换费收入	130,336.95
合计	2,127,113.93

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
审计费用		49,588.57
信息披露费		59,507.37
证券出借违约金		-
债券托管账户维护费		18,600.00
银行划款手续费		14,251.50
合计		141,947.44

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
长城证券	29,439,898.00	0.54	19,915,577.37	1.10

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	27,417.51	0.54	27,168.80	0.82
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	18,547.16	1.14	18,547.16	2.38

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	29,893,405.24	11,512,573.65
其中：支付销售机构的客户维护费	6,576,181.73	2,191,847.52

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,982,234.24	1,918,762.29

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城能源基建混合 A	景顺长城能源基建混合 C	合计
	景顺长城基金管理有限公司	-	715,003.85
农业银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	715,003.85	715,003.85

注：1、基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

2、本基金于 2022 年 11 月 2 日起增加景顺长城能源基建混合型证券投资基金的 C 类基金份额，原有基金份额全部自动划归为本基金 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行-活期	791,306,632.68	2,518,095.60	118,191,481.83	1,747,149.04

注：本基金的活期银行存款由基金托管人农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023年3月	6个月	新股流通	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-

		29 日		受限						
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股 流通 受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股 流通 受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股 流通 受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月 内(含)	新股 流通 受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内(含)	新股 流通 受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股 流通 受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内(含)	新股 流通 受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股 流通 受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023	6 个月	新股	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-

		年 4 月 25 日		流通受限						
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月以上	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	131.11	53.24	261	34,219.71	13,895.64	-
301322	绿通科技	2023 年 5 月 25 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	-	53.24	131	-	6,974.44	转增股
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月	6 个月	新股流通	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-

		11 日		受限						
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股 流通 受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股 流通 受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股 流通 受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股 流通 受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股 流通 受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股 流通 受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023	6 个月	新股	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-

		年 3 月 30 日		流通 受限						
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股 流通 受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股 流通 受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股 流通 受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股 流通 受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股 流通 受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股 流通 受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688435	英方软件	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	38.66	73.03	2,728	105,464.48	199,225.84	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股 流通 受限	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-

688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股 流通 受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股 流通 受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股 流通 受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股 流通 受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股 流通 受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股 流通 受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月	6 个月	新股 流通	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

		19 日		受限					
--	--	------	--	----	--	--	--	--	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30 日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1年	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	791,306,632.68	-	-	-	-	-	791,306,632.68
结算备付金	5,515,738.37	-	-	-	-	-	5,515,738.37
存出保证金	820,472.35	-	-	-	-	-	820,472.35
交易性金融资产	-	-	808,452,602.74	-	-	3,961,077,959.32	4,769,530,562.06

应收申购款	-	-	-	-	-	9,878,468.66	9,878,468.66
应收证券清算款	-	-	-	-	-	22,964.50	22,964.50
资产总计	797,642,843.40	-	808,452,602.74	-	-	3,970,979,392.48	5,577,074,838.62
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,758,093.74	12,758,093.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,854,943.20	6,854,943.20
应付托管费	-	-	-	-	-	1,142,490.55	1,142,490.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-	499,048.89	499,048.89
其他负债	-	-	-	-	-	3,456,706.65	3,456,706.65
负债总计	-	-	-	-	-	24,711,283.03	24,711,283.03
利率敏感度缺口	797,642,843.40	-	808,452,602.74	-	-	-	-
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	160,033,773.11	-	-	-	-	-	160,033,773.11
结算备付金	2,443,027.19	-	-	-	-	-	2,443,027.19
存出保证金	256,608.93	-	-	-	-	-	256,608.93
交易性金融资产	81,617,030.14	-	111,152,860.27	-	-	2,033,174,096.43	2,225,943,986.84
应收申购款	-	-	-	-	-	4,216,876.74	4,216,876.74
应收证券清算款	-	-	-	-	-	322,589.71	322,589.71
资产总计	244,350,439.37	-	111,152,860.27	-	-	2,037,713,562.88	2,393,216,862.52
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,310,635.14	1,310,635.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,928,780.81	2,928,780.81
应付托管费	-	-	-	-	-	488,130.12	488,130.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-	38,440.44	38,440.44
其他负债	-	-	-	-	-	1,334,276.42	1,334,276.42
负债总计	-	-	-	-	-	6,100,262.93	6,100,262.93
利率敏感度缺口	244,350,439.37	-	111,152,860.27	-	-	-	-

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-654, 517. 92	-115, 252. 46
	市场利率下降 25 个基点	655, 579. 52	115, 464. 67

6. 4. 13. 4. 2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

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

6. 4. 13. 4. 3. 1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	3, 961, 077, 959. 32	71. 34	2, 033, 174, 096. 43	85. 17
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	3, 961, 077, 959. 32	71. 34	2, 033, 174, 096. 43	85. 17

6. 4. 13. 4. 3. 2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）

			日)
	沪深 300 指数上升 5%	127,856,336.45	61,839,487.37
	沪深 300 指数下降 5%	-127,856,336.45	-61,839,487.37

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	3,958,794,466.77	2,029,853,055.47
第二层次	809,107,286.64	192,769,890.41
第三层次	1,628,808.65	3,321,040.96
合计	4,769,530,562.06	2,225,943,986.84

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,961,077,959.32	71.02
	其中：股票	3,961,077,959.32	71.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	808,452,602.74	14.50
	其中：债券	808,452,602.74	14.50
	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	796,822,371.05	14.29
8	其他各项资产	10,721,905.51	0.19
9	合计	5,577,074,838.62	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	679,133,075.28	12.23
C	制造业	1,962,589,507.65	35.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	692,462,952.72	12.47
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	230,985,301.52	4.16
G	交通运输、仓储和邮政业	63,325,340.30	1.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	295,901,405.96	5.33
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	3,370,344.48	0.06

N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	14,617,932.86	0.26
R	文化、体育和娱乐业	18,673,842.40	0.34
S	综合	-	-
	合计	3,961,077,959.32	71.34

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	601899	紫金矿业	39,628,776	450,579,183.12	8.12
2	600674	川投能源	23,053,051	346,948,417.55	6.25
3	600025	华能水电	48,454,290	345,479,087.70	6.22
4	600941	中国移动	3,168,709	295,640,549.70	5.32
5	600546	山煤国际	15,957,901	230,910,827.47	4.16
6	300760	迈瑞医疗	749,693	224,757,961.40	4.05
7	000630	铜陵有色	77,626,242	224,339,839.38	4.04
8	002318	久立特材	10,022,351	170,680,637.53	3.07
9	300294	博雅生物	4,565,767	165,646,026.76	2.98
10	603599	广信股份	5,746,500	155,615,220.00	2.80
11	601088	中国神华	3,015,300	92,720,475.00	1.67
12	000333	美的集团	1,541,339	90,815,693.88	1.64
13	600690	海尔智家	3,681,220	86,435,045.60	1.56
14	600938	中国海油	4,601,618	83,381,318.16	1.50
15	002262	恩华药业	2,668,700	82,276,021.00	1.48
16	300470	中密控股	1,709,095	78,994,370.90	1.42
17	300833	浩洋股份	605,457	66,255,159.51	1.19
18	000933	神火股份	4,079,504	53,033,552.00	0.96
19	600026	中远海能	4,192,400	52,991,936.00	0.95
20	601857	中国石油	7,021,700	52,452,099.00	0.94
21	605507	国邦医药	2,448,341	52,076,213.07	0.94
22	002444	巨星科技	2,332,880	51,043,414.40	0.92
23	002484	江海股份	2,360,510	50,255,257.90	0.91
24	603855	华荣股份	1,643,300	43,711,780.00	0.79
25	002182	云海金属	1,852,278	40,731,593.22	0.73
26	600060	海信视像	1,432,552	35,455,662.00	0.64
27	300395	菲利华	628,600	30,927,120.00	0.56
28	605183	确成股份	1,589,900	28,777,190.00	0.52
29	603281	江瀚新材	882,109	27,239,525.92	0.49

30	000902	新洋丰	2,366,428	24,326,879.84	0.44
31	605377	华旺科技	1,341,040	24,205,772.00	0.44
32	688269	凯立新材	367,283	23,428,982.57	0.42
33	601098	中南传媒	1,609,814	18,673,842.40	0.34
34	603043	广州酒家	589,360	16,655,313.60	0.30
35	603882	金城医学	193,300	14,594,150.00	0.26
36	002254	泰和新材	525,900	12,868,773.00	0.23
37	600301	华锡有色	614,200	11,024,890.00	0.20
38	601000	唐山港	2,927,310	10,333,404.30	0.19
39	603896	寿仙谷	215,060	9,527,158.00	0.17
40	688768	容知日新	114,715	9,162,287.05	0.17
41	000738	航发控制	343,600	8,383,840.00	0.15
42	000893	亚钾国际	330,600	7,583,964.00	0.14
43	002020	京新药业	577,600	7,404,832.00	0.13
44	300979	华利集团	129,200	6,297,208.00	0.11
45	002597	金禾实业	238,201	5,621,543.60	0.10
46	002801	微光股份	196,400	5,314,584.00	0.10
47	300012	华测检测	172,100	3,355,950.00	0.06
48	603556	海兴电力	127,900	3,228,196.00	0.06
49	603100	川仪股份	79,905	3,105,108.30	0.06
50	600380	健康元	240,000	3,050,400.00	0.05
51	300888	稳健医疗	65,380	2,724,384.60	0.05
52	002415	海康威视	78,000	2,582,580.00	0.05
53	603833	欧派家居	23,500	2,251,300.00	0.04
54	600031	三一重工	130,238	2,165,857.94	0.04
55	002332	仙琚制药	147,200	1,950,400.00	0.04
56	300357	我武生物	56,300	1,893,369.00	0.03
57	603899	晨光股份	42,200	1,883,808.00	0.03
58	300627	华测导航	54,900	1,782,603.00	0.03
59	300910	瑞丰新材	34,010	1,710,703.00	0.03
60	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
61	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
62	002859	洁美科技	9,300	257,610.00	0.00
63	688102	斯瑞新材	20,653	251,966.60	0.00
64	300408	三环集团	8,400	246,540.00	0.00
65	688435	英方软件	2,728	199,225.84	0.00
66	002028	思源电气	3,800	177,536.00	0.00
67	002709	天赐材料	4,000	164,760.00	0.00
68	002706	良信股份	14,200	159,750.00	0.00
69	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
70	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
71	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
72	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00

73	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
74	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
75	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
76	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
77	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
78	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
79	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
80	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
81	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
82	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
83	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
84	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
85	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
86	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
87	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
88	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
89	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
90	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
91	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
92	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
93	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
94	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
95	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
96	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
97	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
98	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
99	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
100	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
101	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
102	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
103	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
104	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
105	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
106	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
107	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
108	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
109	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
110	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
111	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
112	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
113	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
114	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
115	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00

116	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
117	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
118	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
119	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
120	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
121	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
122	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
123	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
124	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
125	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
126	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
127	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
128	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
129	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
130	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
131	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
132	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
133	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
134	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
135	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
136	001367	海森药业	55	2,171.40	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	601899	紫金矿业	396,376,584.01	16.60
2	000630	铜陵有色	253,622,535.13	10.62
3	300760	迈瑞医疗	218,691,718.20	9.16
4	600546	山煤国际	197,364,737.57	8.27
5	601699	潞安环能	166,743,763.50	6.99
6	002318	久立特材	156,088,190.92	6.54
7	603599	广信股份	145,677,101.04	6.10
8	600690	海尔智家	141,659,360.08	5.93
9	000933	神火股份	135,327,568.55	5.67
10	000333	美的集团	131,015,870.39	5.49
11	600025	华能水电	119,409,144.00	5.00
12	600941	中国移动	111,595,023.00	4.67
13	601088	中国神华	87,952,039.71	3.68
14	300294	博雅生物	80,585,853.22	3.38
15	000807	云铝股份	74,479,794.37	3.12
16	002180	纳思达	71,563,438.96	3.00
17	300470	中密控股	68,998,932.46	2.89
18	600674	川投能源	66,345,485.15	2.78

19	600026	中远海能	56,227,603.00	2.36
20	002182	云海金属	46,051,667.26	1.93

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601928	凤凰传媒	263,991,123.45	11.06
2	601098	中南传媒	185,638,998.57	7.78
3	601699	潞安环能	179,269,114.13	7.51
4	601728	中国电信	131,683,383.77	5.52
5	000333	美的集团	112,499,410.75	4.71
6	600690	海尔智家	102,559,039.00	4.30
7	000933	神火股份	94,562,526.90	3.96
8	600941	中国移动	90,544,249.14	3.79
9	000807	云铝股份	81,613,046.09	3.42
10	002180	纳思达	53,994,569.50	2.26
11	300394	天孚通信	52,200,304.75	2.19
12	002463	沪电股份	47,044,577.70	1.97
13	601857	中国石油	45,954,505.00	1.93
14	601088	中国神华	45,529,408.70	1.91
15	600060	海信视像	42,363,026.38	1.77
16	600161	天坛生物	38,981,568.30	1.63
17	600989	宝丰能源	28,416,757.41	1.19
18	300308	中际旭创	26,934,259.00	1.13
19	600188	兖矿能源	26,133,803.90	1.09
20	601225	陕西煤业	25,760,088.30	1.08

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	3,507,995,635.40
卖出股票收入（成交）总额	1,926,994,865.86

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	808,452,602.74	14.56
	其中：政策性金融债	808,452,602.74	14.56

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	808,452,602.74	14.56

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	220216	22 国开 16	8,000,000	808,452,602.74	14.56

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 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

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。

7.12.2 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	820,472.35
2	应收清算款	22,964.50
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,878,468.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,721,905.51

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 (%)
景顺长城能源基建混合 A	318,955	5,930.36	846,935,090.55	44.78	1,044,581,852.50	55.22
景顺长城能源基建混合 C	40,420	17,513.24	616,024,248.30	87.02	91,860,966.75	12.98
合计	359,375	7,233.12	1,462,959,338.85	56.28	1,136,442,819.25	43.72

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	景顺长城能源基建混合 A	575,435.59	0.030422

人所有从业人员持有本基金	景顺长城能源基建混合 C	36,359.46	0.005136
	合计	611,795.05	0.023536

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	景顺长城能源基建混合 A	-
	景顺长城能源基建混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城能源基建混合 A	0~10
	景顺长城能源基建混合 C	-
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城能源基建混合 A	景顺长城能源基建混合 C
基金合同生效日（2009 年 10 月 20 日）基金份额总额	934,032,709.53	-
本报告期期初基金份额总额	1,228,149,947.86	53,498,686.82
本报告期基金总申购份额	1,343,730,387.96	809,305,319.32
减：本报告期基金总赎回份额	680,363,392.77	154,918,791.09
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,891,516,943.05	707,885,215.05

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
海通证券股份有限公司	1	1,230,845,931.50	22.71	1,146,290.23	22.71	-
东北证券股份有限公司	2	677,410,926.05	12.50	630,882.09	12.50	-
中国国际金融股份有限公司	2	622,536,032.93	11.49	579,771.19	11.49	-
天风证券股份有限公司	1	491,400,442.03	9.07	457,645.15	9.07	-
光大证券股份有限公司	2	473,673,676.05	8.74	441,125.18	8.74	-
川财证券有限责任公司	1	428,400,996.03	7.90	398,974.40	7.90	-
方正证券股份有限公司	2	233,474,250.05	4.31	217,434.04	4.31	-
华创证券有限责任公司	1	191,952,591.17	3.54	178,760.45	3.54	-
中泰证券股份有限公司	2	186,180,911.65	3.44	173,390.32	3.44	-
中国银河证券股份有限公司	2	130,906,194.26	2.42	121,913.36	2.42	-
国信证券股份有限公司	1	116,826,457.49	2.16	108,799.38	2.16	-
东兴证券股份有限公司	1	111,135,619.50	2.05	103,500.33	2.05	-
东方证券股份有限公司	2	108,698,737.25	2.01	101,229.26	2.01	-
招商证券股份有限公司	2	84,003,110.77	1.55	78,235.29	1.55	-
长江证券股份有限公司	2	66,414,236.97	1.23	61,852.97	1.23	-

广发证券股份有限公司	2	65,729,162.77	1.21	61,212.65	1.21	-
国金证券股份有限公司	1	55,847,371.30	1.03	52,010.49	1.03	-
民生证券股份有限公司	1	54,936,172.54	1.01	51,162.68	1.01	-
长城证券股份有限公司	1	29,439,898.00	0.54	27,417.51	0.54	-
兴业证券股份有限公司	1	23,767,830.20	0.44	22,134.72	0.44	-
恒泰证券股份有限公司	1	18,714,727.40	0.35	17,428.93	0.35	-
国盛证券有限责任公司	1	12,686,167.06	0.23	11,814.56	0.23	-
中信证券股份有限公司	6	4,966,092.00	0.09	4,624.79	0.09	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

注：1. 基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

a、资金实力雄厚，信誉良好；

b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；

d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；

e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

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

2. 本基金本期交易单元未发生变更。

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 (%)
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增渤海证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 9 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
3	景顺长城能源基建混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 10 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 24 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增山西证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 9 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 25 日
8	景顺长城能源基建混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增青岛银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 7 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 8 日
12	关于景顺长城能源基建混合型证券投资基金暂停接受贰佰万元以上申购（含日常申购和定期定额申购）及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 11 日

13	关于旗下部分基金新增杭州银行股份有限公司杭 e 家平台为销售平台并开通基金转换业务及参加申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 12 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 18 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
16	景顺长城能源基建混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 22 日
18	关于旗下部分基金新增中国光大银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 28 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 6 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 13 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增德邦证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 26 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 27 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 10 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 17 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城能源基建股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城能源基建混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城能源基建混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城能源基建混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日