

景顺长城资源垄断混合型证券投资基金
(LOF)
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	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
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	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43

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	43
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	44
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	44
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	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末上市基金前十名持有人	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.4 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	45
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	景顺长城资源垄断混合（LOF）
场内简称	景顺资源 LOF
基金主代码	162607
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2006 年 1 月 26 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,132,612,995.70 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2006 年 4 月 7 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以长期看好中国经济增长和资本市场发展为立足点，重点投资于具有自然资源优势以及垄断优势的优秀上市公司股票，以获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资于具有自然资源优势以及垄断优势的优秀上市公司的股票比例至少高于股票投资的 80%。从业务价值、估值、管理能力、自由现金流量与分红政策四个方面结合必要的合理性分析对上市公司的品质和估值水平进行鉴别，选择目标股票构建组合。债券投资部分着重本金安全性和流动性。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+中国债券总指数×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	秦一楠
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.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	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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)
本期已实现收益	70,900,676.36
本期利润	-51,683,479.38
加权平均基金份额本期利润	-0.0116
本期加权平均净值利润率	-2.04%
本期基金份额净值增长率	-2.17%
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	439,691,013.33
期末可供分配基金份额利润	0.1064
期末基金资产净值	2,234,842,205.59
期末基金份额净值	0.541
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	753.11%

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

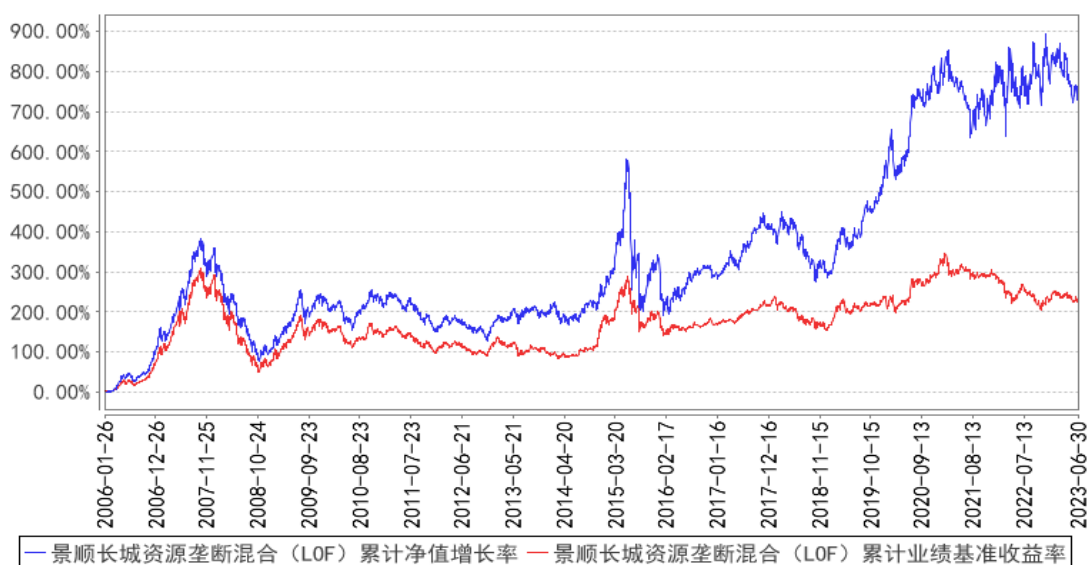
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.05%	1.50%	1.04%	0.69%	2.01%	0.81%
过去三个月	-5.75%	1.13%	-3.75%	0.66%	-2.00%	0.47%
过去六个月	-2.17%	1.22%	-0.03%	0.67%	-2.14%	0.55%
过去一年	-5.91%	1.58%	-10.69%	0.79%	4.78%	0.79%
过去三年	14.01%	1.60%	-3.16%	0.96%	17.17%	0.64%
自基金合同生效起至今	753.11%	1.67%	228.42%	1.31%	524.69%	0.36%

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

景顺长城资源垄断混合（LOF）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：对于股票的投资不少于基金资产净值的 65%，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%。本基金投资于具有自然资源优势以及垄断优势的优质上市公司的股票比例至少高于股票投资的 80%。按照本基金基金合同的规定，本基金自 2006 年 1 月 26 日合同生效日起至 2006 年 4 月 25 日为建仓期。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。自 2017 年 9 月 15 日起，本基金业绩比较基准由“富时中国 A200 指数×80%+中国债券总指数×20%”变更为“沪深 300 指数×80%+中国债券总指数×20%”。

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		
韩文强	本基金的基金经理	2020年4月29日	-	14年	管理学博士。曾任中国人寿资产管理有限公司基金投资部研究员、投资经理。2019年8月加入本公司，自2019年10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14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、《景顺长城资源垄断混合型证券投资基金

金（LOF）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

回顾上半年海内外的经济，海外方面，今年上半年，美国经济的韧性超出市场预期。虽然欧美在高通胀及货币政策快速紧缩的压力下隐现衰退风险，且以欧美银行业为代表的部分风险点也已有所暴露，但美国经济在服务业的支撑下，就业、消费等数据持续超出市场预期，在很大程度上抵补了货币紧缩的压力，呈现出相当的韧性。国内方面，一季度经济在疫情压制需求集中释放下修复明显，随着补偿性需求释放完全，二季度基本面略有回落，居民部门持续去杠杆，社融增速大幅回落，消费、地产销售数据不及预期，工业企业盈利承压，企业持续主动去库，生产走弱。

上半年，本基金保持了较高的仓位，出于对经济底部的判断，虽然我们也认为底部的形态很难是 V 型，持续时间也可能较长，但经济启动的时点和催化剂往往都是事后才能清晰可见，对投资来说更确定的是坚信经济复苏一定回来，经济不可能持续的弱，无论是经济的周期性还是整个社会对经济持续弱的忍耐力都是有底限的，而股票市场通常会领先最终的经济复苏，且过去的经验看 90%的涨幅在 10%的交易日，也就是说大部分的时间都是等待，而这种等待的意义在于这是模糊的正确，一定要看到明确的经济复苏，往往会犯精确的错误，错过最有弹性的行情。基于这样的判断，我们的组合结构主要在一线改善房地产开放商、功能性具备更新需求的建材龙头、造船龙头、体检龙头、中药、具备成本优势且有一定成长性的生猪龙头。前两个行业主要是下注经济

复苏，后面的行业均是自身的行业周期进入拐点且与经济相关性不大，这样可以适当对冲组合的风险。我们没有为了分散去分散，配置一堆跟经济相关的行业，看似分散实则是一个大贝塔。选择的与经济复苏相关的行业均是经济复苏前段的行业，一些经济复苏后段才受益的行业，我们会在经济复苏相对明确后逐渐置换，比如计算机等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年上半年，本基金份额净值增长率为-2.17%，业绩比较基准收益率为-0.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，从海外来看，随着货币紧缩的维持，以及信贷条件进一步收紧，依然制约美国经济基本面的修复空间。不过因为美国积累的较高的超额储蓄尚未释放完全，以及服务业尚有一定修复空间，就业依然保持韧性，经济失速的风险不大。货币政策方面，美联储货币政策从“急加息”转为“观望期”。美联储自 2022 年 3 月开启史上最快加息周期以来，加息速度先升后落（25→50→75→50→25），6 月会议跳过加息，但是上调点阵图，传递下半年“每两次会议加 25BP”信号，显示美联储处于政策观察期。国内方面，“稳增长”政策有望加快落地，或可阶段性支撑基建、地产，但居民部门去杠杆的长期行为较难扭转。地方政府方面，今年土地市场仍然萎靡，政府性基金收入持续负增长，城投企业债务压力较大，此外持续多年高基建后也缺乏足够的能产生稳定收益的优质项目。出口方面，虽然美国商品终端销售具有一定韧性，但是美国贸易商尚处于主动去库存阶段，叠加收紧的金融环境压制基本面的上行空间，预计短期内我国出口将继续承压。资金方面，5 月以来 DR007 周均值处于政策利率下方，6 月 13 日逆回购利率调降 10bp 至 1.9%，随后 1 年 MLF 利率和 LPR 利率同样下调。我们认为当前经济压力较大，尚需货币政策的呵护，下半年货币政策预期维持宽松，预期流动性保持合理充裕。经济周期从冷到热，往复循环。经历了 3 年疫情，包括房地产行业的衰退，经济已处于历史相对低位，后续稳增长政策大概率会陆续出台，相信经济将会再次复苏，只是现在经济体量太大，回升启动的速率会比过去的经济底部来得慢，需要耐心。

总之，我们相信随着经济的复苏，市场能再次进入类似于 2016、2017 年的行情。

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、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：景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）

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	139,581,407.34	163,142,424.62
结算备付金		676,451.86	3,126,930.02
存出保证金		303,334.55	375,829.03
交易性金融资产	6.4.7.2	2,098,781,626.88	2,334,605,248.51
其中：股票投资		2,098,781,626.88	2,334,605,248.51
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		325,308.76	70,083.12
应收股利		-	-
应收申购款		525,814.87	1,721,978.41
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,240,193,944.26	2,503,042,493.71
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		-	5,800,512.22
应付赎回款		837,520.17	1,028,906.54
应付管理人报酬		2,863,626.01	3,330,285.09
应付托管费		477,270.99	555,047.53
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		19,054.30	19,054.30
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,154,267.20	1,560,791.79
负债合计		5,351,738.67	12,294,597.47
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,795,151,192.26	1,958,125,869.92
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	439,691,013.33	532,622,026.32
净资产合计		2,234,842,205.59	2,490,747,896.24
负债和净资产总计		2,240,193,944.26	2,503,042,493.71

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.541 元，基金份额总额 4,132,612,995.70 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）

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		-29,515,289.22	74,376,094.68
1. 利息收入		663,397.05	477,518.62
其中：存款利息收入	6.4.7.13	663,397.05	477,518.62
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		91,897,353.55	-196,633,853.56
其中：股票投资收益	6.4.7.14	78,227,372.82	-205,801,755.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	13,669,980.73	9,167,901.98
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	-122,584,155.74	269,928,292.05
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	508,115.92	604,137.57
减：二、营业总支出		22,168,190.16	16,098,809.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	18,886,877.49	13,682,728.57
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,147,812.86	2,280,454.82
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	133,499.81	135,626.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-51,683,479.38	58,277,285.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-51,683,479.38	58,277,285.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-51,683,479.38	58,277,285.06

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）

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）	1,958,125,869.92	-	532,622,026.32	2,490,747,896.24
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）	1,958,125,869.92	-	532,622,026.32	2,490,747,896.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-162,974,677.66	-	-92,931,012.99	-255,905,690.65
（一）、综合收益总额	-	-	-51,683,479.38	-51,683,479.38
（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）	-162,974,677.66	-	-41,247,533.61	-204,222,211.27
其中：1. 基金申购款	177,661,537.38	-	61,071,396.22	238,732,933.60
2. 基金赎回款	-340,636,215.04	-	-102,318,929.83	-442,955,144.87
（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）	1,795,151,192.26	-	439,691,013.33	2,234,842,205.59
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）	1,367,305,116.21	-	507,156,495.43	1,874,461,611.64
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）	1,367,305,116.21	-	507,156,495.43	1,874,461,611.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	112,084,389.76	-	-28,397,598.70	83,686,791.06
（一）、综合收益总额	-	-	58,277,285.06	58,277,285.06
（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）	112,084,389.76	-	39,275,428.39	151,359,818.15
其中：1. 基金申购款	485,501,484.51	-	135,914,364.03	621,415,848.54
2. 基金赎回款	-373,417,094.75	-	-96,638,935.64	-470,056,030.39
（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）	-	-	-125,950,312.15	-125,950,312.15
（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）	1,479,389,505.97	-	478,758,896.73	1,958,148,402.70

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

景顺长城资源垄断混合型证券投资基金 (LOF) (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”) 证监基金字[2005]第 179 号《关于同意景顺长城资源垄断股票型证券投资基金 (LOF) 募集的批复》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《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式, 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 1,154,861,946.80 元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 8 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金 (LOF) 基金合

同》于 2006 年 1 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,155,234,378.92 份基金份额，其中认购资金利息折合 372,432.12 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上字[2006]第 24 号文审核同意，本基金 18,634,653.00 份基金份额于 2006 年 4 月 7 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）招募说明书》和《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）基金份额拆分公告》的有关规定，本基金于 2007 年 7 月 26 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 2.301455159，并于 2007 年 7 月 27 日进行了变更登记。根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，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。本基金主要投资于股票类资产，股票投资的比例不少于基金资产净值的 65%，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。根据《景顺长城基金管理有限公司关于变更景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）业绩比较基准并相应修订基金合同的公告》，本基金的业绩比较基准自 2017 年 9 月 15 日起变更为：沪深 300 指数 X80%+中国债券总指数 X20%。本基金的原业绩比较基准为：富时中国 A200 指数 X80%+中国债券总指数 X20%。

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

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前(如适用)运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税

额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起(如适用)产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	139,581,407.34
等于：本金	139,553,582.86
加：应计利息	27,824.48
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	139,581,407.34

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	2,100,614,982.30	-	2,098,781,626.88	-1,833,355.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,100,614,982.30	-	2,098,781,626.88	-1,833,355.42

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	1,303.84
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,034,867.42
其中：交易所市场	1,034,867.42
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	118,095.94
合计	1,154,267.20

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,507,758,289.49	1,958,125,869.92
本期申购	409,016,766.14	177,661,537.38
本期赎回（以“-”号填列）	-784,162,059.93	-340,636,215.04
本期末	4,132,612,995.70	1,795,151,192.26

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,803,672,367.06	-1,271,050,340.74	532,622,026.32
本期利润	70,900,676.36	-122,584,155.74	-51,683,479.38
本期基金份额交易产生的变动数	-154,729,707.54	113,482,173.93	-41,247,533.61
其中：基金申购款	165,342,145.22	-104,270,749.00	61,071,396.22
基金赎回款	-320,071,852.76	217,752,922.93	-102,318,929.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,719,843,335.88	-1,280,152,322.55	439,691,013.33

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	647,499.74
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	11,738.34
其他	4,158.97
合计	663,397.05

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	78,227,372.82
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	78,227,372.82

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	1,267,022,980.71
减：卖出股票成本总额	1,185,176,584.40
减：交易费用	3,619,023.49
买卖股票差价收入	78,227,372.82

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

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	13,669,980.73
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	13,669,980.73

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	-122,584,155.74
股票投资	-122,584,155.74
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-122,584,155.74

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	504,613.37
基金转换费收入	3,502.55
合计	508,115.92

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	5,803.87
合计	133,499.81

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、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：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

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		上年度可比期间 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	88,786,482.91	3.82	581,729,235.79	19.05

6.4.10.1.2 权证交易

无。

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	83,111.48	3.84	44,266.00	4.28

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	541,760.40	19.05	50,687.92	4.61

注：1. 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。

2. 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	18,886,877.49	13,682,728.57
其中：支付销售机构的客户维护费	3,033,406.07	1,888,541.50

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

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	3,147,812.86	2,280,454.82

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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		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	
	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	139,581,407.34	647,499.74	121,353,441.17	445,307.09

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行同业利率计息。

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

本基金本报告期内无利润分配。

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 29 日	6 个月	新股 流通 受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
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	-
002044	美年健康	2023 年 1 月 11 日	6 个月	大宗 交易 流通 受限	5.91	7.02	1,700,000	10,047,000.00	11,934,000.00	-
002044	美年健康	2023 年 1 月 17 日	6 个月	大宗 交易 流通 受限	5.82	6.99	1,300,000	7,566,000.00	9,087,000.00	-
002044	美年健康	2023 年 1 月 18 日	6 个月	大宗 交易 流通 受限	5.74	6.99	1,300,000	7,462,000.00	9,087,000.00	-
002044	美年健康	2023 年 1 月 13 日	6 个月	大宗 交易 流通 受限	5.69	7.01	700,000	3,983,000.00	4,907,000.00	-
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 个月	新股	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-

		6月28日		流通受限						
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年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
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11 日	6个月	新股 流通 受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
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	6个月	新股 流通	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-

		日		受限						
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年 3月30 日	6个月	新股 流通 受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
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	6个月	新股	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-

		5月12日		流通受限						
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	-
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	二元科技	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 19 日	6 个月	新股 流通 受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本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

截止本报告期末，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

截止本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

合久期等方法管理利率风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	139,581,407.34	-	-	-	-	-	139,581,407.34
结算备付金	676,451.86	-	-	-	-	-	676,451.86
存出保证金	303,334.55	-	-	-	-	-	303,334.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,098,781,626.88	2,098,781,626.88
应收申购款	1,534.02	-	-	-	-	524,280.85	525,814.87
应收证券清算款	-	-	-	-	-	325,308.76	325,308.76
资产总计	140,562,727.77	-	-	-	-	-2,099,631,216.49	2,240,193,944.26
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	837,520.17	837,520.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,863,626.01	2,863,626.01
应付托管费	-	-	-	-	-	477,270.99	477,270.99
应交税费	-	-	-	-	-	19,054.30	19,054.30
其他负债	-	-	-	-	-	1,154,267.20	1,154,267.20
负债总计	-	-	-	-	-	5,351,738.67	5,351,738.67
利率敏感度缺口	140,562,727.77	-	-	-	-	-	-
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	163,142,424.62	-	-	-	-	-	163,142,424.62
结算备付金	3,126,930.02	-	-	-	-	-	3,126,930.02
存出保证金	375,829.03	-	-	-	-	-	375,829.03
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,334,605,248.51	2,334,605,248.51
应收申购款	5,515.70	-	-	-	-	1,716,462.71	1,721,978.41
应收证券清算款	-	-	-	-	-	70,083.12	70,083.12
资产总计	166,650,699.37	-	-	-	-	-2,336,391,794.34	2,503,042,493.71
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,028,906.54	1,028,906.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,330,285.09	3,330,285.09
应付托管费	-	-	-	-	-	555,047.53	555,047.53
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,800,512.22	5,800,512.22
应交税费	-	-	-	-	-	19,054.30	19,054.30
其他负债	-	-	-	-	-	1,560,791.79	1,560,791.79

负债总计	-	-	-	-	12,294,597.47	12,294,597.47
利率敏感度缺口	166,650,699.37	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有债券资产（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	2,098,781,626.88	93.91	2,334,605,248.51	93.73
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	2,098,781,626.88	93.91	2,334,605,248.51	93.73

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)
	沪深 300 指数上升 5%	110, 123, 935. 36	127, 077, 158. 82
	沪深 300 指数下降 5%	-110, 123, 935. 36	-127, 077, 158. 82

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	2, 061, 682, 360. 17	2, 332, 361, 542. 13
第二层次	654, 683. 90	-
第三层次	36, 444, 582. 81	2, 243, 706. 38
合计	2, 098, 781, 626. 88	2, 334, 605, 248. 51

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6. 4. 14. 3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022 年 12 月 31 日：同）。

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	2,098,781,626.88	93.69
	其中：股票	2,098,781,626.88	93.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	140,257,859.20	6.26
8	其他各项资产	1,154,458.18	0.05
9	合计	2,240,193,944.26	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	319,294,631.20	14.29
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,032,743,930.95	46.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	73,851,908.93	3.30
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,630.42	0.00

J	金融业	-	-
K	房地产业	467,495,195.06	20.92
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
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	205,266,232.22	9.18
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,098,781,626.88	93.91

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	002044	美年健康	28,941,976	205,242,449.36	9.18
2	002244	滨江集团	22,853,076	201,564,130.32	9.02
3	600150	中国船舶	5,959,737	196,134,944.67	8.78
4	002271	东方雨虹	6,851,570	186,773,798.20	8.36
5	300498	温氏股份	10,094,240	185,229,304.00	8.29
6	603737	三棵树	2,724,788	178,255,630.96	7.98
7	300737	科顺股份	18,530,658	169,740,827.28	7.60
8	600325	华发股份	15,153,678	149,263,728.30	6.68
9	300026	红日药业	23,578,863	127,797,437.46	5.72
10	603477	巨星农牧	3,669,732	122,385,562.20	5.48
11	001979	招商蛇口	8,953,748	116,667,336.44	5.22
12	600153	建发股份	6,762,368	73,777,434.88	3.30
13	002853	皮阿诺	3,022,289	52,285,599.70	2.34
14	000786	北新建材	1,943,900	47,644,989.00	2.13
15	002541	鸿路钢构	1,078,940	31,084,261.40	1.39
16	002372	伟星新材	1,029,095	21,137,611.30	0.95
17	688276	百克生物	237,769	14,884,339.40	0.67
18	002714	牧原股份	277,100	11,679,765.00	0.52
19	002043	兔宝宝	452,600	4,937,866.00	0.22
20	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
21	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
22	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
23	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
24	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.00
25	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00

26	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
27	301308	江波龙	819	83,341.44	0.00
28	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
29	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
30	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
31	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
32	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
33	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
34	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
35	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
36	603281	江瀚新材	1,208	37,303.04	0.00
37	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
38	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
39	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
40	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
41	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
42	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
43	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.00
44	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
45	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
46	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
47	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
48	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
49	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
50	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
51	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
52	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
53	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
54	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
55	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
56	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
57	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
58	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
59	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
60	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
61	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
62	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
63	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
64	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
65	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
66	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
67	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
68	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00

69	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
70	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
71	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
72	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
73	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
74	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
75	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
76	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
77	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
78	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
79	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
80	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
81	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
82	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
83	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
84	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
85	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
86	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
87	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
88	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
89	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
90	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
91	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	300498	温氏股份	201,448,243.60	8.09
2	002714	牧原股份	146,485,067.62	5.88
3	002044	美年健康	139,688,802.71	5.61
4	603477	巨星农牧	113,521,451.20	4.56
5	600941	中国移动	61,375,245.47	2.46
6	600975	新五丰	49,833,908.49	2.00
7	000786	北新建材	47,838,112.00	1.92
8	600050	中国联通	46,932,489.00	1.88
9	002791	坚朗五金	43,895,158.57	1.76
10	002100	天康生物	35,531,270.70	1.43
11	002541	鸿路钢构	31,950,818.52	1.28
12	600150	中国船舶	26,434,160.82	1.06
13	002372	伟星新材	21,719,964.53	0.87
14	001979	招商蛇口	18,924,849.52	0.76
15	688276	百克生物	18,879,325.47	0.76
16	002043	兔宝宝	17,089,946.00	0.69

17	603737	三棵树	15,817,123.00	0.64
18	600153	建发股份	10,714,092.00	0.43
19	002007	华兰生物	5,091,194.00	0.20
20	002853	皮阿诺	3,722,929.00	0.15

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	600048	保利发展	185,249,607.38	7.44
2	002714	牧原股份	128,207,657.94	5.15
3	600153	建发股份	114,107,051.24	4.58
4	600150	中国船舶	111,591,436.00	4.48
5	001979	招商蛇口	90,984,855.32	3.65
6	600325	华发股份	85,251,897.30	3.42
7	300026	红日药业	69,626,274.48	2.80
8	600941	中国移动	67,216,631.87	2.70
9	000623	吉林敖东	62,274,454.43	2.50
10	600685	中船防务	61,454,769.56	2.47
11	001914	招商积余	60,776,712.42	2.44
12	600050	中国联通	54,218,595.00	2.18
13	600975	新五丰	45,059,673.26	1.81
14	002791	坚朗五金	36,877,294.03	1.48
15	002100	天康生物	33,812,918.74	1.36
16	002271	东方雨虹	14,742,704.41	0.59
17	002043	兔宝宝	11,188,498.00	0.45
18	002007	华兰生物	5,043,642.00	0.20
19	688276	百克生物	4,571,455.93	0.18
20	603477	巨星农牧	2,912,781.00	0.12

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	1,071,937,118.51
卖出股票收入（成交）总额	1,267,022,980.71

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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	303,334.55
2	应收清算款	325,308.76
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	525,814.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,154,458.18

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002044	美年健康	35,015,000.00	1.57	大宗交易流通受限

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

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（%）
73,746	56,038.47	2,010,467,780.63	48.65	2,122,145,215.07	51.35

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	栾贵超	1,584,281.00	2.38
2	戴荣文	1,439,698.00	2.16
3	张移平	1,394,588.00	2.09
4	黄国建	1,169,942.00	1.76
5	彭惠华	1,030,000.00	1.55
6	徐进球	1,023,628.00	1.54
7	王淑娟	692,587.00	1.04
8	李继民	672,700.00	1.01
9	石康文	665,707.00	1.00
10	赵久玲	649,837.00	0.98

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	148,870.58	0.003602

8.4 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

基金合同生效日（2006 年 1 月 26 日） 基金份额总额	1, 155, 234, 378. 92
本报告期期初基金份额总额	4, 507, 758, 289. 49
本报告期基金总申购份额	409, 016, 766. 14
减：本报告期基金总赎回份额	784, 162, 059. 93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4, 132, 612, 995. 70

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

本基金本报告期内未更换会计师事务所。

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(%)	
中信证券股份有限公司	4	1,119,954,058.30	48.19	1,043,027.47	48.18	-
民生证券股份有限公司	1	316,825,283.97	13.63	295,061.89	13.63	-
天风证券股份有限公司	1	152,441,663.30	6.56	141,968.22	6.56	-
中国国际金融股份有限公司	1	109,721,647.21	4.72	102,183.85	4.72	-
长城证券股份有限公司	2	88,786,482.91	3.82	83,111.48	3.84	-
中泰证券股份有限公司	1	81,061,843.88	3.49	75,493.46	3.49	-
东北证券股份有限公司	1	78,742,314.98	3.39	73,332.20	3.39	-
兴业证券股份有限公司	1	69,516,915.43	2.99	64,741.41	2.99	-
东方证券股份有限公司	1	57,528,186.66	2.48	53,575.66	2.47	-
方正证券股份有限公司	1	55,861,371.66	2.40	52,024.13	2.40	-
东兴证券股份有限公司	1	54,527,377.11	2.35	50,781.21	2.35	-
国金证券股份有限公司	1	47,279,701.84	2.03	44,030.98	2.03	-
长江证券股份有限公司	1	26,834,792.56	1.15	24,991.63	1.15	-
光大证券股份有限公司	1	20,478,900.50	0.88	19,071.97	0.88	-
恒泰证券股份有限公司	1	19,483,729.90	0.84	18,145.30	0.84	-
国盛证券有限责任公司	1	10,012,350.09	0.43	9,324.90	0.43	-
国信证券股份有限公司	1	8,238,801.63	0.35	7,672.41	0.35	-
中国银河证券股份有限公司	2	4,048,257.00	0.17	3,770.36	0.17	-

招商证券股份有限公司	1	2,573,454.00	0.11	2,396.68	0.11	-
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	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	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	-	-	-	-	-

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

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众禄基金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 12 日
2	景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）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
3	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
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旗下部分基金新增济安财富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 2 月 14 日
6	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
7	关于旗下部分基金参加华安证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 6 日
8	关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司银银平台“机构投资交易平台”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 3 月 21 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2023 年 3 月 25 日

	停机维护的公告	网站	
10	景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
11	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
12	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
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	景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）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
16	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
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	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
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 13 日
20	景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）2023 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 26 日
21	景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新	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旗下部分基金新增万家财富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 5 月 29 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 10 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 17 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增成长基金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 6 月 20 日

27	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101-20230630	1,549,175,156.68	0.00	54,247,739.60	1,494,927,417.08	36.17

产品特有风险

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

1、大额申购风险

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

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

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

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

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

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

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

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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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资源垄断股票型证券投资基金（LOF）募集注册的文件；
- 2、《景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）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