

景顺长城量化新动力股票型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	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	9
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真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57

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	57
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	57
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	57
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化新动力股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城量化新动力股票
场内简称	无
基金主代码	001974
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 7 月 13 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	453,401,673.25 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型精选股票，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略：本基金股票资产占基金资产的比例范围为 80%-95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略：本基金主要采用超额收益模型、风险模型、成本模型三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。</p> <p>3、债券投资策略：出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p>
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际指数(MSCI China A International Index) 收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95588

传真	0755-22381339	(010) 66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	李进	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-11,256,655.33
本期利润	-14,428,656.84
加权平均基金份额本期利润	-0.0297
本期加权平均净值利润率	-1.51%
本期基金份额净值增长率	-1.80%
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	402,082,293.10
期末可供分配基金份额利润	0.8868
期末基金资产净值	864,173,973.70
期末基金份额净值	1.906
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	90.60%

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。

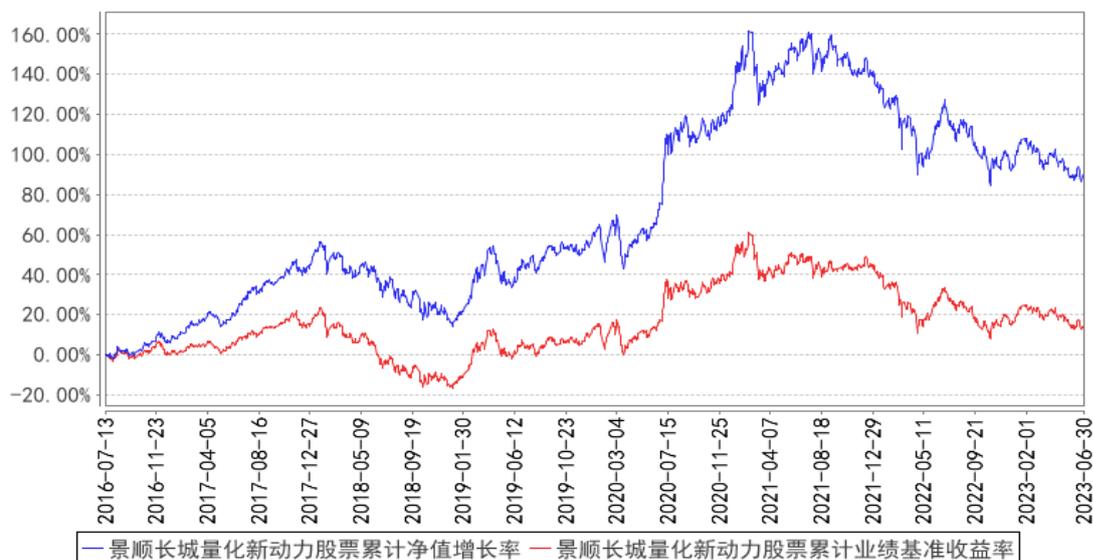
3.2 基金净值表现

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	1.17%	0.73%	0.35%	0.82%	0.82%	-0.09%
过去三个月	-4.08%	0.69%	-5.80%	0.74%	1.72%	-0.05%
过去六个月	-1.80%	0.73%	-2.15%	0.75%	0.35%	-0.02%
过去一年	-15.02%	0.89%	-14.16%	0.89%	-0.86%	0.00%
过去三年	6.84%	1.13%	-3.81%	1.12%	10.65%	0.01%
自基金合同生效起至今	90.60%	1.12%	13.89%	1.10%	76.71%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

景顺长城量化新动力股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 80%–95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%–20%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为 0–3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2016 年 7 月 13 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

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		
黎海威	本基金的基金经理	2016 年 7 月 13 日	-	20 年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有 20 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、《景顺长城量化新动力股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

2023 年上半年，国内经济整体呈现出弱复苏的态势，服务业的复苏较为明显，制造业和地产的复苏仍需观察，权益市场的表现也反映了较弱的经济和基本面预期。从国内来看，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 49.2、48.8、49.0，今年前 5 个月工业增加值累计同比增长 3.6%，其中 5 月份工业增加值当月同比增长 3.5%，经济复苏的节奏出现放缓的迹象。6 月 PPI 同比下降 5.4%，环比下降 0.8%；CPI 同比持平，环比下降 0.2%，通胀依旧温和。6 月 M2 同比增长 11.3%，M1 同比增速 3.1%，流动性充裕；6 月末外汇储备 3.19 万亿美元，汇率短期承压。整体而言，国内货币政策总体保持稳健，流动性充裕，宏观环境总体温和，经济依然是弱复苏的态势。上半年 A 股市场呈现出先涨后跌的态势，风格上来看，价值风格优于成长风格。综合来看，上半年上证指数上涨 3.65%、沪深 300 指数下跌 0.75%，创业板指数下跌 5.61%。

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-1.80%，业绩比较基准收益率为-2.15%。

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 2023 年下半年，海外方面，通胀大概率继续回落，美联储的货币政策依然是市场关注的热点，但其对国内资本市场的边际影响明显降低。国内方面，“稳增长”政策有望加快落地，或可对经济形成一定支撑，下半年货币政策预期维持宽松，预期流动性保持合理充裕。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。我们的投资组合仍然会维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生长期投资回报。

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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城量化新动力股票型证券投资基金

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	57,318,210.23	58,993,690.13
结算备付金		7,040,962.96	5,058,643.09
存出保证金		144,055.46	184,232.38
交易性金融资产	6.4.7.2	803,875,410.49	949,859,239.11

其中：股票投资		803,367,373.20	949,859,239.11
基金投资		-	-
债券投资		508,037.29	-
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		310,652.94	325,521.00
应收股利		-	-
应收申购款		69,422.52	212,246.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		868,758,714.60	1,014,633,571.76
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		1,183,389.36	2,743,557.98
应付管理人报酬		1,071,762.59	1,318,537.22
应付托管费		178,627.11	219,756.19
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.12	0.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,150,960.72	3,769,718.55
负债合计		4,584,740.90	8,051,570.38
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	453,401,673.25	518,513,438.99
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	410,772,300.45	488,068,562.39
净资产合计		864,173,973.70	1,006,582,001.38
负债和净资产总计		868,758,714.60	1,014,633,571.76

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.906 元，基金份额总额 453,401,673.25 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化新动力股票型证券投资基金

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		-5,974,814.08	-81,323,540.87
1. 利息收入		159,575.92	180,925.57
其中：存款利息收入	6.4.7.13	159,575.92	180,925.57
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）		-3,110,658.51	-152,373,941.03
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-16,231,409.48	-166,226,472.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	36.29	1,223,504.16
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	13,120,714.68	12,629,027.21
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	-3,172,001.51	70,127,449.90
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	148,270.02	742,024.69
减：二、营业总支出		8,453,842.76	10,765,100.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,152,022.83	9,133,112.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,192,003.87	1,522,185.35
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		0.12	0.95
8. 其他费用	6.4.7.23	109,815.94	109,801.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,428,656.84	-92,088,641.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,428,656.84	-92,088,641.17
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-14,428,656.84	-92,088,641.17

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城量化新动力股票型证券投资基金

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）	518,513,438.99	-	488,068,562.39	1,006,582,001.38
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）	518,513,438.99	-	488,068,562.39	1,006,582,001.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-65,111,765.74	-	-77,296,261.94	-142,408,027.68
（一）、综合收益总额	-	-	-14,428,656.84	-14,428,656.84
（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）	-65,111,765.74	-	-62,867,605.10	-127,979,370.84

其中：1. 基金申购款	23,145,913.03	-	23,409,881.38	46,555,794.41
2. 基金赎回款	-88,257,678.77	-	-86,277,486.48	-174,535,165.25
(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)	453,401,673.25	-	410,772,300.45	864,173,973.70
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)	591,779,325.36	-	836,840,281.35	1,428,619,606.71
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)	591,779,325.36	-	836,840,281.35	1,428,619,606.71
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,463,795.66	-	-103,200,933.25	-104,664,728.91
(一)、综合收益总额	-	-	-92,088,641.17	-92,088,641.17
(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)	-1,463,795.66	-	-11,112,292.08	-12,576,087.74
其中：1. 基金申购款	153,846,679.62	-	166,379,726.32	320,226,405.94
2. 基金赎回款	-155,310,475.28	-	-177,492,018.40	-332,802,493.68
(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）	590,315,529.70	-	733,639,348.10	1,323,954,877.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城量化新动力股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 1537 号《关于准予景顺长城量化新动力股票型证券投资基金注册的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化新动力股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 219,177,460.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 891 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城量化新动力股票型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 219,324,726.66 份基金份额,其中认购资金利息折合 147,266.66 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化新动力股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、债券(含中小企业私募债)、货币市场工具、权证、资产支持性证券、股指期货以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为 80%-95%;除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-20%,其中权证资产占基金资产净值的比例范围为 0-3%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的

政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股国际指数(MSCI China A International Index)收益率 X95%+商业银行活期存款利率(税后)X5%。

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	57,318,210.23
等于:本金	57,313,415.37
加:应计利息	4,794.86
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	57,318,210.23

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	827,254,985.13	-	803,367,373.20	-23,887,611.93	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	508,000.00	37.29	508,037.29	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	508,000.00	37.29	508,037.29	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	827,762,985.13	37.29	803,875,410.49	-23,887,611.93	

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	1,478.60
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,040,386.18
其中：交易所市场	2,040,386.18
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	2,150,960.72

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	518,513,438.99	518,513,438.99
本期申购	23,145,913.03	23,145,913.03
本期赎回（以“-”号填列）	-88,257,678.77	-88,257,678.77
本期末	453,401,673.25	453,401,673.25

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	473,997,205.18	14,071,357.21	488,068,562.39
本期利润	-11,256,655.33	-3,172,001.51	-14,428,656.84
本期基金份额交易产生的变动数	-60,658,256.75	-2,209,348.35	-62,867,605.10
其中：基金申购款	21,380,831.65	2,029,049.73	23,409,881.38
基金赎回款	-82,039,088.40	-4,238,398.08	-86,277,486.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	402,082,293.10	8,690,007.35	410,772,300.45

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	107,448.82
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	50,603.54
其他	1,523.56
合计	159,575.92

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	-16,231,409.48
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	-16,231,409.48

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	2,639,076,068.90
减：卖出股票成本总额	2,647,484,460.66
减：交易费用	7,823,017.72
买卖股票差价收入	-16,231,409.48

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	36.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	36.29
----	-------

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

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	13,120,714.68
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	13,120,714.68

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	-3,172,001.51
股票投资	-3,172,001.51
债券投资	-

资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-3,172,001.51

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	141,528.63
基金转换费收入	6,741.39
合计	148,270.02

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	-
银行划款手续费	720.00
合计	109,815.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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	35,720,224.95	0.70	230,936,439.42	3.10

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	33,266.77	0.70	33,266.77	1.63
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	215,074.10	3.10	215,074.10	6.03

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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月	2022年1月1日至2022年

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,152,022.83	9,133,112.06
其中：支付销售机构的客户维护费	3,131,446.93	4,055,546.11

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	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
当期发生的基金应支付的托管费	1,192,003.87	1,522,185.35

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，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 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
中国工商银行-活期	57,318,210.23	107,448.82	82,958,153.87	137,032.99

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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	-

				限						
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	-
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	2023	6个月	新	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-

	威股份	年6月28日		股流通受限						
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	2023年6月29日	6个月	新股流	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-

	源	日		通受限						
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	2023	6个月	新	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-

	方长龙	年4月11日		股流通受限						
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	1,306	31,043.62	56,014.34	-
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	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-

		日		通受限						
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	3,064	20,161.12	23,225.12	-
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	-

				限						
601916	浙商银行	2023年6月27日	1个月内(含)	配股流通受限	2.02	2.64	998,550	2,017,071.00	2,636,172.00	-
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	875	31,631.25	33,363.75	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	5,788	114,949.68	104,531.28	-
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	2023	6个月	新	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-

	中科技	年4月11日		股流通受限						
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	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	37.88	29.49	1,898	71,896.24	55,972.02	-
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	10,930	62,191.70	59,131.30	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流	11.10	17.04	3,812	42,313.20	64,956.48	-

		日		通受限						
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	-

				限						
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	2023	6个月	新	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

	斯 信 息	年 6 月 19 日		股 流 通 受 限						
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功 认购 日	受限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 (单 位 : 张)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
118036	力 合 转 债	2023 年 6 月 29 日	1 个 月 内(含)	新 债 未 上 市	100.00	100.00	790	79,000.00	79,001.56	-
127086	恒 邦 转 债	2023 年 6 月 12 日	1 个 月 内(含)	新 债 未 上 市	100.00	100.01	4,290	429,000.00	429,035.73	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股 票 名 称	停 牌 日 期	停 牌 原 因	期 末 估 值 单 价	复 牌 日 期	复 牌 开 盘 单 价	数 量 (股)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
601298	青 岛 港	2023 年 6 月 28 日	重 大 事 项 停 牌	6.97	2023 年 7 月 3 日	7.40	135,000	940,787.00	940,950.00	-

注：本基金截至 2023 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌
的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.06%（上年度末：0.00%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风

险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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	57,318,210.23	-	-	-	-	-	57,318,210.23
结算备付金	7,040,962.96	-	-	-	-	-	7,040,962.96
存出保证金	144,055.46	-	-	-	-	-	144,055.46
交易性金融资产	-	-	-	-	508,037.29	803,367,373.20	803,875,410.49
应收申购款	-	-	-	-	-	69,422.52	69,422.52
应收证券清算款	-	-	-	-	-	310,652.94	310,652.94
资产总计	64,503,228.65	-	-	-	508,037.29	803,747,448.66	868,758,714.60
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,183,389.36	1,183,389.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,071,762.59	1,071,762.59
应付托管费	-	-	-	-	-	178,627.11	178,627.11
应交税费	-	-	-	-	-	1.12	1.12
其他负债	-	-	-	-	-	2,150,960.72	2,150,960.72
负债总计	-	-	-	-	-	4,584,740.90	4,584,740.90
利率敏感度缺口	64,503,228.65	-	-	-	508,037.29	-	-
上年度末	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

2022 年 12 月 31 日		月	年	年			
资产							
银行存款	58,993,690.13	-	-	-	-	-	58,993,690.13
结算备付金	5,058,643.09	-	-	-	-	-	5,058,643.09
存出保证金	184,232.38	-	-	-	-	-	184,232.38
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-949,859,239.11	949,859,239.11
应收申购款	-	-	-	-	-	212,246.05	212,246.05
应收证券清算款	-	-	-	-	-	325,521.00	325,521.00
资产总计	64,236,565.60	-	-	-	-	-950,397,006.16	1,014,633,571.76
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,743,557.98	2,743,557.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,318,537.22	1,318,537.22
应付托管费	-	-	-	-	-	219,756.19	219,756.19
应交税费	-	-	-	-	-	0.44	0.44
其他负债	-	-	-	-	-	3,769,718.55	3,769,718.55
负债总计	-	-	-	-	-	8,051,570.38	8,051,570.38
利率敏感度缺口	64,236,565.60	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.06%（上年度末：0.00%），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	803,367,373.20	92.96	949,859,239.11	94.36
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	803,367,373.20	92.96	949,859,239.11	94.36

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%	35,008,776.17	42,465,295.37
	沪深 300 指数下降 5%	-35,008,776.17	-42,465,295.37

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	797,869,070.29	946,564,462.35
第二层次	4,739,843.19	-
第三层次	1,266,497.01	3,294,776.76
合计	803,875,410.49	949,859,239.11

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	803,367,373.20	92.47
	其中：股票	803,367,373.20	92.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	508,037.29	0.06
	其中：债券	508,037.29	0.06
	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	64,359,173.19	7.41
8	其他各项资产	524,130.92	0.06
9	合计	868,758,714.60	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	11,004,645.00	1.27
B	采矿业	46,467,086.14	5.38
C	制造业	423,815,703.64	49.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,758,564.02	3.91
E	建筑业	23,701,876.55	2.74
F	批发和零售业	18,941,360.41	2.19
G	交通运输、仓储和邮政业	21,189,033.00	2.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,432,044.68	6.53
J	金融业	128,036,276.18	14.82
K	房地产业	15,177,760.04	1.76
L	租赁和商务服务业	11,571,687.00	1.34
M	科学研究和技术服务业	8,092,826.68	0.94
N	水利、环境和公共设施管理业	1,759,735.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	2,303,398.00	0.27
S	综合	1,091,594.00	0.13
	合计	803,367,373.20	92.96

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	21,970	37,151,270.00	4.30
2	300750	宁德时代	74,400	17,021,976.00	1.97

3	000858	五粮液	100,800	16,487,856.00	1.91
4	601318	中国平安	306,324	14,213,433.60	1.64
5	600309	万华化学	117,200	10,294,848.00	1.19
6	002594	比亚迪	39,100	10,098,357.00	1.17
7	601916	浙商银行	3,685,550	9,729,852.00	1.13
8	002697	红旗连锁	1,545,500	9,025,720.00	1.04
9	000725	京东方 A	2,154,700	8,812,723.00	1.02
10	600438	通威股份	254,639	8,736,664.09	1.01
11	601006	大秦铁路	1,097,300	8,152,939.00	0.94
12	600919	江苏银行	1,098,139	8,071,321.65	0.93
13	601688	华泰证券	578,460	7,965,394.20	0.92
14	601169	北京银行	1,710,795	7,920,980.85	0.92
15	002422	科伦药业	266,400	7,906,752.00	0.91
16	000425	徐工机械	1,167,400	7,903,298.00	0.91
17	000338	潍柴动力	630,800	7,859,768.00	0.91
18	600642	申能股份	1,122,900	7,849,071.00	0.91
19	600089	特变电工	347,784	7,752,105.36	0.90
20	002027	分众传媒	1,135,700	7,734,117.00	0.89
21	601618	中国中冶	1,936,700	7,688,699.00	0.89
22	600570	恒生电子	173,460	7,682,543.40	0.89
23	000063	中兴通讯	163,500	7,445,790.00	0.86
24	002600	领益智造	1,066,700	7,370,897.00	0.85
25	600489	中金黄金	710,360	7,338,018.80	0.85
26	601939	建设银行	1,167,600	7,309,176.00	0.85
27	002129	TCL 中环	219,650	7,292,380.00	0.84
28	601377	兴业证券	1,190,297	7,284,617.64	0.84
29	600036	招商银行	219,600	7,194,096.00	0.83
30	002223	鱼跃医疗	199,200	7,169,208.00	0.83
31	600161	天坛生物	263,132	7,144,033.80	0.83
32	600837	海通证券	765,700	7,059,754.00	0.82
33	600050	中国联通	1,458,900	7,002,720.00	0.81
34	601958	金钼股份	625,500	6,974,325.00	0.81
35	000651	格力电器	190,800	6,966,108.00	0.81
36	600096	云天化	407,885	6,962,596.95	0.81
37	600039	四川路桥	698,040	6,847,772.40	0.79
38	600901	江苏金租	1,619,940	6,690,352.20	0.77
39	601328	交通银行	1,144,500	6,638,100.00	0.77
40	600497	驰宏锌锗	1,318,600	6,619,372.00	0.77
41	600256	广汇能源	961,869	6,598,421.34	0.76
42	600582	天地科技	1,128,800	6,580,904.00	0.76
43	601186	中国铁建	667,600	6,575,860.00	0.76
44	601000	唐山港	1,841,400	6,500,142.00	0.75
45	600585	海螺水泥	260,800	6,191,392.00	0.72

46	300760	迈瑞医疗	20,520	6,151,896.00	0.71
47	603259	药明康德	98,420	6,132,550.20	0.71
48	600863	内蒙华电	1,428,017	5,926,270.55	0.69
49	688981	中芯国际	112,194	5,668,040.88	0.66
50	002179	中航光电	121,400	5,505,490.00	0.64
51	688396	华润微	104,329	5,467,882.89	0.63
52	600064	南京高科	825,500	5,456,555.00	0.63
53	000513	丽珠集团	137,132	5,335,806.12	0.62
54	002966	苏州银行	790,600	5,178,430.00	0.60
55	600985	淮北矿业	446,200	5,140,224.00	0.59
56	601766	中国中车	746,400	4,851,600.00	0.56
57	002065	东华软件	684,800	4,834,688.00	0.56
58	000591	太阳能	711,600	4,824,648.00	0.56
59	600598	北大荒	360,000	4,798,800.00	0.56
60	002049	紫光国微	50,900	4,746,425.00	0.55
61	000568	泸州老窖	22,182	4,648,681.74	0.54
62	600909	华安证券	975,700	4,556,519.00	0.53
63	601077	渝农商行	1,262,800	4,533,452.00	0.52
64	601021	春秋航空	78,600	4,517,142.00	0.52
65	600875	东方电气	239,500	4,466,675.00	0.52
66	000997	新大陆	233,300	4,409,370.00	0.51
67	601607	上海医药	193,200	4,329,612.00	0.50
68	601128	常熟银行	626,100	4,270,002.00	0.49
69	300511	雪榕生物	560,425	4,259,230.00	0.49
70	688018	乐鑫科技	32,577	4,229,146.14	0.49
71	603688	石英股份	36,800	4,189,312.00	0.48
72	600886	国投电力	325,300	4,115,045.00	0.48
73	600941	中国移动	43,100	4,021,230.00	0.47
74	600637	东方明珠	498,300	3,896,706.00	0.45
75	600938	中国海油	214,000	3,877,680.00	0.45
76	600011	华能国际	416,900	3,860,494.00	0.45
77	600057	厦门象屿	441,100	3,837,570.00	0.44
78	600845	宝信软件	74,556	3,788,190.36	0.44
79	600750	江中药业	170,800	3,745,644.00	0.43
80	600566	济川药业	120,600	3,502,224.00	0.41
81	688111	金山办公	7,300	3,447,206.00	0.40
82	000301	东方盛虹	290,300	3,431,346.00	0.40
83	000733	振华科技	34,700	3,325,995.00	0.38
84	600998	九州通	319,754	3,319,046.52	0.38
85	688008	澜起科技	57,372	3,294,300.24	0.38
86	603027	千禾味业	154,800	3,269,376.00	0.38
87	600900	长江电力	147,300	3,249,438.00	0.38
88	000630	铜陵有色	1,067,400	3,084,786.00	0.36

89	000157	中联重科	447,000	3,017,250.00	0.35
90	603369	今世缘	55,000	2,904,000.00	0.34
91	688599	天合光能	67,146	2,861,091.06	0.33
92	002056	横店东磁	152,800	2,782,488.00	0.32
93	002371	北方华创	8,600	2,731,790.00	0.32
94	601211	国泰君安	185,855	2,600,111.45	0.30
95	600048	保利发展	188,400	2,454,852.00	0.28
96	002249	大洋电机	411,800	2,347,260.00	0.27
97	600458	时代新材	181,700	2,178,583.00	0.25
98	000002	万 科 A	153,152	2,147,191.04	0.25
99	600536	中国软件	45,002	2,109,693.76	0.24
100	601818	光大银行	621,300	1,907,391.00	0.22
101	002273	水晶光电	151,290	1,806,402.60	0.21
102	002737	葵花药业	74,200	1,806,028.00	0.21
103	300777	中简科技	36,300	1,715,538.00	0.20
104	000623	吉林敖东	104,400	1,674,576.00	0.19
105	002466	天齐锂业	23,900	1,670,849.00	0.19
106	601311	骆驼股份	172,500	1,600,800.00	0.19
107	688012	中微公司	10,200	1,595,790.00	0.18
108	001979	招商蛇口	121,800	1,587,054.00	0.18
109	600271	航天信息	114,900	1,572,981.00	0.18
110	002299	圣农发展	79,700	1,526,255.00	0.18
111	600572	康恩贝	221,900	1,520,015.00	0.18
112	601336	新华保险	41,267	1,517,387.59	0.18
113	002028	思源电气	32,400	1,513,728.00	0.18
114	002384	东山精密	57,300	1,484,070.00	0.17
115	601555	东吴证券	212,700	1,476,138.00	0.17
116	002185	华天科技	148,300	1,364,360.00	0.16
117	002624	完美世界	79,600	1,344,444.00	0.16
118	000783	长江证券	231,200	1,340,960.00	0.16
119	600988	赤峰黄金	98,900	1,331,194.00	0.15
120	300308	中际旭创	8,800	1,297,560.00	0.15
121	601168	西部矿业	122,800	1,290,628.00	0.15
122	002138	顺络电子	53,900	1,288,749.00	0.15
123	002465	海格通信	124,400	1,286,296.00	0.15
124	600879	航天电子	151,400	1,285,386.00	0.15
125	300136	信维通信	63,900	1,283,112.00	0.15
126	002294	信立泰	39,300	1,225,767.00	0.14
127	600177	雅戈尔	193,800	1,222,878.00	0.14
128	603589	口子窖	24,600	1,214,010.00	0.14
129	601877	正泰电器	43,500	1,202,775.00	0.14
130	601577	长沙银行	152,400	1,182,624.00	0.14
131	688009	中国通号	203,179	1,178,438.20	0.14

132	600528	中铁工业	117,100	1,156,948.00	0.13
133	688536	思瑞浦	5,300	1,155,400.00	0.13
134	600535	天士力	79,300	1,150,643.00	0.13
135	600820	隧道股份	190,600	1,145,506.00	0.13
136	600498	烽火通信	56,100	1,142,757.00	0.13
137	002025	航天电器	17,900	1,142,020.00	0.13
138	002926	华西证券	137,200	1,140,132.00	0.13
139	600584	长电科技	36,500	1,137,705.00	0.13
140	002092	中泰化学	176,300	1,137,135.00	0.13
141	002152	广电运通	96,000	1,125,120.00	0.13
142	603927	中科软	29,100	1,122,096.00	0.13
143	603517	绝味食品	30,000	1,114,500.00	0.13
144	000625	长安汽车	86,000	1,111,980.00	0.13
145	688116	天奈科技	24,200	1,107,150.00	0.13
146	603858	步长制药	53,700	1,105,683.00	0.13
147	600390	五矿资本	205,400	1,105,052.00	0.13
148	600038	中直股份	27,700	1,103,014.00	0.13
149	002128	电投能源	83,300	1,101,226.00	0.13
150	600895	张江高科	78,600	1,094,112.00	0.13
151	601231	环旭电子	73,100	1,093,576.00	0.13
152	688002	睿创微纳	24,400	1,093,120.00	0.13
153	600673	东阳光	151,400	1,091,594.00	0.13
154	000050	深天马 A	117,900	1,082,322.00	0.13
155	603893	瑞芯微	14,800	1,078,180.00	0.12
156	002326	永太科技	69,689	1,065,544.81	0.12
157	688779	长远锂科	94,326	1,063,054.02	0.12
158	000778	新兴铸管	257,800	1,051,824.00	0.12
159	603026	胜华新材	17,714	1,049,554.50	0.12
160	002153	石基信息	74,900	1,048,600.00	0.12
161	600959	江苏有线	310,100	1,048,138.00	0.12
162	600517	国网英大	183,400	1,045,380.00	0.12
163	600339	中油工程	254,700	1,036,629.00	0.12
164	603228	景旺电子	40,400	1,036,260.00	0.12
165	000598	兴蓉环境	190,800	1,036,044.00	0.12
166	600967	内蒙一机	101,900	1,029,190.00	0.12
167	002690	美亚光电	39,900	1,027,425.00	0.12
168	600801	华新水泥	83,100	1,026,285.00	0.12
169	600663	陆家嘴	103,800	1,024,506.00	0.12
170	600500	中化国际	184,000	1,023,040.00	0.12
171	601598	中国外运	218,700	1,019,142.00	0.12
172	000883	湖北能源	222,400	1,014,144.00	0.12
173	688107	安路科技	18,300	1,013,637.00	0.12
174	002791	坚朗五金	15,600	1,009,476.00	0.12

175	603529	爱玛科技	31,300	1,008,486.00	0.12
176	002423	中粮资本	125,800	1,006,400.00	0.12
177	000156	华数传媒	115,500	1,004,850.00	0.12
178	601611	中国核建	118,800	1,003,860.00	0.12
179	002250	联化科技	95,300	996,838.00	0.12
180	000559	万向钱潮	181,800	990,810.00	0.11
181	300850	新强联	26,400	986,832.00	0.11
182	000400	许继电气	42,800	986,540.00	0.11
183	002673	西部证券	154,500	981,075.00	0.11
184	601098	中南传媒	84,500	980,200.00	0.11
185	000967	盈峰环境	193,900	979,195.00	0.11
186	600755	厦门国贸	125,900	974,466.00	0.11
187	002653	海思科	41,100	969,960.00	0.11
188	600597	光明乳业	93,200	969,280.00	0.11
189	002925	盈趣科技	49,800	966,120.00	0.11
190	002563	森马服饰	155,000	964,100.00	0.11
191	600968	海油发展	312,900	960,603.00	0.11
192	601717	郑煤机	76,900	957,405.00	0.11
193	600126	杭钢股份	220,000	954,800.00	0.11
194	600195	中牧股份	81,300	949,584.00	0.11
195	600867	通化东宝	90,300	942,732.00	0.11
196	601298	青岛港	135,000	940,950.00	0.11
197	001203	大中矿业	83,900	932,129.00	0.11
198	600928	西安银行	264,700	931,744.00	0.11
199	601158	重庆水务	166,900	927,964.00	0.11
200	688185	康希诺	11,300	920,950.00	0.11
201	601139	深圳燃气	126,200	919,998.00	0.11
202	600612	老凤祥	13,000	908,440.00	0.11
203	000776	广发证券	61,100	898,781.00	0.10
204	000869	张裕 A	29,200	895,272.00	0.10
205	603444	吉比特	1,800	883,998.00	0.10
206	688295	中复神鹰	23,900	876,652.00	0.10
207	600152	维科技术	94,300	875,104.00	0.10
208	300529	健帆生物	37,400	866,932.00	0.10
209	300993	玉马遮阳	75,634	866,009.30	0.10
210	688560	明冠新材	31,000	861,490.00	0.10
211	300691	联合光电	48,600	856,332.00	0.10
212	688589	力合微	20,800	847,392.00	0.10
213	600478	科力远	118,200	843,948.00	0.10
214	000987	越秀资本	132,600	842,010.00	0.10
215	002860	星帅尔	62,400	841,152.00	0.10
216	001696	宗申动力	118,000	835,440.00	0.10
217	601003	柳钢股份	206,300	833,452.00	0.10

218	300035	中科电气	69,200	831,784.00	0.10
219	002651	利君股份	107,000	831,390.00	0.10
220	300531	优博讯	58,700	830,018.00	0.10
221	300134	大富科技	80,600	826,150.00	0.10
222	002150	通润装备	48,600	825,714.00	0.10
223	002373	千方科技	60,400	823,856.00	0.10
224	688105	诺唯赞	27,000	823,230.00	0.10
225	002237	恒邦股份	75,100	817,839.00	0.09
226	000541	佛山照明	143,200	817,672.00	0.09
227	603018	华设集团	93,200	815,500.00	0.09
228	000603	盛达资源	67,400	814,866.00	0.09
229	688425	铁建重工	168,653	811,220.93	0.09
230	603501	韦尔股份	8,235	807,359.40	0.09
231	300482	万孚生物	30,300	806,889.00	0.09
232	601998	中信银行	134,300	803,114.00	0.09
233	000629	钒钛股份	205,300	802,723.00	0.09
234	600862	中航高科	31,600	799,796.00	0.09
235	300558	贝达药业	16,600	797,298.00	0.09
236	300613	富瀚微	14,000	794,360.00	0.09
237	601028	玉龙股份	73,800	793,350.00	0.09
238	688200	华峰测控	5,180	792,540.00	0.09
239	002655	共达电声	60,700	788,493.00	0.09
240	002549	凯美特气	67,200	772,800.00	0.09
241	605358	立昂微	21,000	771,330.00	0.09
242	601686	友发集团	112,400	768,816.00	0.09
243	688072	拓荆科技	1,800	766,746.00	0.09
244	300363	博腾股份	25,700	760,463.00	0.09
245	688276	百克生物	11,900	744,940.00	0.09
246	603737	三棵树	11,200	732,704.00	0.08
247	300316	晶盛机电	10,200	723,180.00	0.08
248	300438	鹏辉能源	14,600	701,384.00	0.08
249	600329	达仁堂	15,600	700,284.00	0.08
250	688029	南微医学	8,400	685,104.00	0.08
251	688348	昱能科技	3,500	657,405.00	0.08
252	000688	国城矿业	43,000	652,310.00	0.08
253	600481	双良节能	46,600	651,468.00	0.08
254	300590	移为通信	53,100	648,882.00	0.08
255	601898	中煤能源	75,300	635,532.00	0.07
256	603595	东尼电子	14,700	629,454.00	0.07
257	600419	天润乳业	38,800	629,336.00	0.07
258	000739	普洛药业	34,100	604,934.00	0.07
259	600141	兴发集团	27,100	602,162.00	0.07
260	000066	中国长城	42,900	593,307.00	0.07

261	688123	聚辰股份	11,000	590,920.00	0.07
262	600848	上海临港	49,400	590,330.00	0.07
263	600446	金证股份	40,500	588,870.00	0.07
264	000975	银泰黄金	47,400	554,580.00	0.06
265	300487	蓝晓科技	8,800	549,296.00	0.06
266	002915	中欣氟材	31,800	531,378.00	0.06
267	300604	长川科技	10,900	517,641.00	0.06
268	600383	金地集团	71,200	513,352.00	0.06
269	688786	悦安新材	10,800	501,012.00	0.06
270	301026	浩通科技	13,800	492,936.00	0.06
271	002155	湖南黄金	40,200	490,440.00	0.06
272	000589	贵州轮胎	86,700	485,520.00	0.06
273	603826	坤彩科技	9,600	480,000.00	0.06
274	002074	国轩高科	17,300	477,826.00	0.06
275	600062	华润双鹤	26,600	463,372.00	0.05
276	000958	电投产融	106,500	461,145.00	0.05
277	300296	利亚德	68,300	445,999.00	0.05
278	603212	赛伍技术	20,900	434,929.00	0.05
279	600398	海澜之家	62,500	430,000.00	0.05
280	002956	西麦食品	27,400	428,262.00	0.05
281	688303	大全能源	10,500	424,725.00	0.05
282	600378	昊华科技	11,200	421,568.00	0.05
283	002772	众兴菌业	37,200	420,360.00	0.05
284	600085	同仁堂	7,200	414,432.00	0.05
285	603267	鸿远电子	6,300	411,390.00	0.05
286	300735	光弘科技	35,500	379,850.00	0.04
287	600704	物产中大	72,200	356,668.00	0.04
288	300802	矩子科技	14,100	339,387.00	0.04
289	603639	海利尔	18,900	338,688.00	0.04
290	002636	金安国纪	35,500	327,665.00	0.04
291	605377	华旺科技	17,700	319,485.00	0.04
292	600373	中文传媒	23,900	318,348.00	0.04
293	002568	百润股份	8,700	316,245.00	0.04
294	002949	华阳国际	21,600	307,152.00	0.04
295	002518	科士达	7,500	300,075.00	0.03
296	603355	莱克电气	11,800	299,838.00	0.03
297	002410	广联达	8,940	290,460.60	0.03
298	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.03
299	603379	三美股份	11,600	272,716.00	0.03
300	601012	隆基绿能	9,400	269,498.00	0.03
301	688256	寒武纪	1,400	263,200.00	0.03
302	002017	东信和平	19,600	256,956.00	0.03
303	002268	电科网安	9,000	250,830.00	0.03

304	300183	东软载波	15,100	249,301.00	0.03
305	002203	海亮股份	20,700	248,607.00	0.03
306	600185	格力地产	35,700	244,902.00	0.03
307	688390	固德威	1,400	233,604.00	0.03
308	300515	三德科技	14,300	230,516.00	0.03
309	600060	海信视像	9,200	227,700.00	0.03
310	600707	彩虹股份	47,600	226,576.00	0.03
311	300896	爱美客	500	222,475.00	0.03
312	000887	中鼎股份	16,600	217,294.00	0.03
313	603515	欧普照明	10,000	203,000.00	0.02
314	600887	伊利股份	6,800	192,576.00	0.02
315	002051	中工国际	15,900	189,687.00	0.02
316	603156	养元饮品	7,400	182,780.00	0.02
317	002500	山西证券	32,500	181,350.00	0.02
318	603516	淳中科技	6,200	136,710.00	0.02
319	603613	国联股份	3,500	129,255.00	0.01
320	688557	兰剑智能	3,600	127,008.00	0.01
321	600502	安徽建工	22,900	120,912.00	0.01
322	600667	太极实业	16,400	119,064.00	0.01
323	600508	上海能源	8,100	118,908.00	0.01
324	688778	厦钨新能	2,400	118,800.00	0.01
325	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
326	688120	华海清科	447	112,666.35	0.01
327	688249	晶合集成	5,788	104,531.28	0.01
328	688281	华秦科技	500	101,250.00	0.01
329	300820	英杰电气	1,200	98,856.00	0.01
330	688127	蓝特光学	5,100	89,913.00	0.01
331	688225	亚信安全	4,000	83,800.00	0.01
332	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
333	002745	木林森	8,400	77,280.00	0.01
334	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
335	688037	芯源微	444	75,901.80	0.01
336	002441	众业达	6,600	75,240.00	0.01
337	002156	通富微电	3,300	74,580.00	0.01
338	603345	安井食品	500	73,400.00	0.01
339	688630	芯碁微装	868	72,929.36	0.01
340	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
341	688596	正帆科技	1,600	69,280.00	0.01
342	300260	新莱应材	1,740	68,764.80	0.01
343	603690	至纯科技	1,920	66,892.80	0.01
344	300567	精测电子	700	66,605.00	0.01
345	688082	盛美上海	600	66,240.00	0.01
346	688472	阿特斯	3,812	64,956.48	0.01

347	600641	万业企业	3,400	64,906.00	0.01
348	002158	汉钟精机	2,600	64,896.00	0.01
349	603236	移远通信	1,100	63,481.00	0.01
350	300666	江丰电子	900	61,164.00	0.01
351	688469	中芯集成	10,930	59,131.30	0.01
352	001872	招商港口	3,400	58,718.00	0.01
353	301358	湖南裕能	1,306	56,014.34	0.01
354	688443	智翔金泰	1,898	55,972.02	0.01
355	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.01
356	688183	生益电子	4,000	48,400.00	0.01
357	688531	日联科技	346	47,045.62	0.01
358	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
359	002583	海能达	6,700	38,927.00	0.00
360	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
361	688146	中船特气	875	33,363.75	0.00
362	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
363	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
364	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
365	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
366	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
367	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
368	688168	安博通	700	24,920.00	0.00
369	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
370	601061	中信金属	3,064	23,225.12	0.00
371	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
372	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
373	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
374	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
375	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
376	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
377	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
378	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
379	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
380	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
381	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
382	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
383	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
384	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
385	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
386	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
387	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
388	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
389	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00

390	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
391	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
392	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
393	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
394	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
395	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
396	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
397	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
398	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
399	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
400	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
401	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
402	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
403	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
404	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
405	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
406	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
407	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
408	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
409	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
410	002432	九安医疗	200	7,042.00	0.00
411	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
412	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
413	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
414	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
415	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
416	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
417	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
418	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	600519	贵州茅台	40,261,915.00	4.00
2	000858	五粮液	34,517,466.66	3.43
3	601390	中国中铁	33,702,017.36	3.35
4	002027	分众传媒	32,002,939.00	3.18
5	600795	国电电力	31,163,228.15	3.10
6	601318	中国平安	27,650,651.71	2.75
7	002049	紫光国微	26,546,903.00	2.64
8	000776	广发证券	25,799,595.00	2.56
9	601336	新华保险	25,322,900.66	2.52

10	600039	四川路桥	25,095,135.00	2.49
11	603290	斯达半导	24,191,207.00	2.40
12	000725	京东方 A	23,954,108.00	2.38
13	000513	丽珠集团	23,199,146.01	2.30
14	000895	双汇发展	22,581,975.00	2.24
15	601618	中国中冶	22,368,359.00	2.22
16	600570	恒生电子	21,145,491.22	2.10
17	601916	浙商银行	20,956,640.00	2.08
18	600352	浙江龙盛	20,656,764.00	2.05
19	600153	建发股份	20,426,247.00	2.03
20	600438	通威股份	20,124,925.00	2.00

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601390	中国中铁	57,220,544.50	5.68
2	002049	紫光国微	39,123,048.80	3.89
3	000895	双汇发展	36,678,567.86	3.64
4	600741	华域汽车	36,559,716.00	3.63
5	601601	中国太保	33,858,170.39	3.36
6	601668	中国建筑	32,631,548.60	3.24
7	000568	泸州老窖	31,673,368.00	3.15
8	600519	贵州茅台	31,042,002.00	3.08
9	600438	通威股份	30,471,289.82	3.03
10	601555	东吴证券	30,113,965.65	2.99
11	000651	格力电器	29,819,197.00	2.96
12	600795	国电电力	29,775,648.84	2.96
13	601318	中国平安	29,429,612.68	2.92
14	002594	比亚迪	28,961,343.25	2.88
15	600809	山西汾酒	28,528,045.04	2.83
16	601336	新华保险	28,431,062.00	2.82
17	300009	安科生物	27,901,691.40	2.77
18	603369	今世缘	27,676,854.00	2.75
19	600089	特变电工	26,395,693.01	2.62
20	002074	国轩高科	26,342,030.00	2.62
21	601231	环旭电子	26,273,437.81	2.61
22	002027	分众传媒	25,666,687.00	2.55
23	002938	鹏鼎控股	25,498,928.00	2.53
24	600837	海通证券	25,359,346.98	2.52
25	000776	广发证券	23,211,162.00	2.31
26	600919	江苏银行	23,145,898.90	2.30
27	600153	建发股份	23,042,886.00	2.29

28	601128	常熟银行	22,968,892.97	2.28
29	002807	江阴银行	22,827,748.00	2.27
30	000001	平安银行	22,321,374.96	2.22
31	600009	上海机场	22,125,559.32	2.20
32	000876	新希望	21,082,676.00	2.09
33	603290	斯达半导	20,800,672.30	2.07
34	002304	洋河股份	20,793,339.00	2.07
35	000513	丽珠集团	20,255,704.00	2.01

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	2,504,164,596.26
卖出股票收入（成交）总额	2,639,076,068.90

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	508,037.29	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	508,037.29	0.06

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	127086	恒邦转债	4,290	429,035.73	0.05
2	118036	力合转债	790	79,001.56	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率和交易成本。

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

中国平安保险（集团）股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	144,055.46
2	应收清算款	310,652.94
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	69,422.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	524,130.92
---	----	------------

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	601916	浙商银行	2,636,172.00	0.31	配股流通受限

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 (%)
201,330	2,252.03	31,580,395.68	6.97	421,821,277.57	93.03

8.2 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	360,117.19	0.079426

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	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2016 年 7 月 13 日) 基金份额总额	219,324,726.66
本报告期期初基金份额总额	518,513,438.99
本报告期基金总申购份额	23,145,913.03
减：本报告期基金总赎回份额	88,257,678.77
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	453,401,673.25
-------------	----------------

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 (%)	
国海证券股份有限公司	1	796,528,454.73	15.53	741,807.37	15.53	-

公司						
中信建投证券股份有限公司	2	709,342,058.09	13.83	660,619.69	13.83	-
中信证券股份有限公司	3	535,280,904.80	10.44	498,502.56	10.44	-
中国国际金融股份有限公司	2	407,464,150.58	7.95	379,480.43	7.95	-
申万宏源证券有限公司	1	348,520,684.97	6.80	324,585.66	6.80	-
天风证券股份有限公司	1	302,965,320.55	5.91	282,153.50	5.91	-
开源证券股份有限公司	2	253,213,168.98	4.94	235,813.02	4.94	本报告新增2个
华创证券有限责任公司	1	245,836,776.67	4.79	228,948.89	4.79	-
民生证券股份有限公司	1	235,503,226.58	4.59	219,330.09	4.59	-
华西证券股份有限公司	1	226,132,137.90	4.41	210,602.99	4.41	-
国泰君安证券股份有限公司	1	216,832,411.00	4.23	201,934.19	4.23	-
中邮证券股份有限公司	1	149,067,977.83	2.91	138,824.97	2.91	本报告新增1个
方正证券股份有限公司	2	108,178,511.72	2.11	100,744.09	2.11	-
第一创业证券股份有限公司	1	106,058,985.12	2.07	98,775.89	2.07	-
国金证券股份有限	1	104,151,284.50	2.03	96,995.65	2.03	-

公司						
中国银河证券股份有限公司	1	99,317,719.82	1.94	92,495.38	1.94	-
中银国际证券股份有限公司	1	71,095,067.05	1.39	66,214.52	1.39	-
安信证券股份有限公司	1	69,467,779.45	1.35	64,696.15	1.35	-
太平洋证券股份有限公司	1	64,396,063.12	1.26	59,972.27	1.26	-
长城证券股份有限公司	1	35,720,224.95	0.70	33,266.77	0.70	-
兴业证券股份有限公司	1	35,367,634.70	0.69	32,937.82	0.69	-
东方证券股份有限公司	3	4,953,623.30	0.10	4,613.24	0.10	-
东方财富证券股份有限公司	2	1,294,793.10	0.03	1,205.95	0.03	-
中航证券股份有限公司	2	465,663.49	0.01	433.67	0.01	-
光大证券股份有限公司	2	288,486.00	0.01	268.67	0.01	本期报告新增2个
东亚前海证券有限责任公司	1	213,227.02	0.00	198.61	0.00	-
高盛(中国)证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国都证券股份有限	2	-	-	-	-	本期报告

公司						新增 1 个
国盛证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
瑞信证券 (中国)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	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
中泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

注：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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

民生证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华西证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中邮证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
方正证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
第一创 业证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
安信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
太平洋 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	-	-	-	-	-	-
东方证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中航证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东亚前 海证券 有限责 任公司	-	-	-	-	-	-
高盛(中 国)证券 有限责 任公司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国都证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-

海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞信证券(中国)有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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
2	景顺长城量化新动力股票型证券投资基金 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
3	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
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 24 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 3 月 25 日

6	景顺长城量化新动力股票型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
7	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
8	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
9	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
10	景顺长城量化新动力股票型证券投资基金 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
11	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
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 22 日
13	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
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 13 日
15	景顺长城量化新动力股票型证券投资基金 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
16	景顺长城量化新动力股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 26 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 5 月 27 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 6 月 10 日
19	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 6 月 16 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 6 月 17 日
21	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量化新动力股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城量化新动力股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城量化新动力股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城量化新动力股票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