

景顺长城优选混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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 | 5 |
| 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 | 7 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 7 |
| 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 | 8 |
| 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 | 9 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 净资产变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 36 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 37 |
| 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 | 37 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 39 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 40 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 40 |
| 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 | 41 |
| 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 | 41 |
| 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 | 41 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 41 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 41 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 41 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 42 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 42 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 42 |
| 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 | 42 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 42 |
| § 10 重大事件揭示 | 43 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 43 |
| 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 | 43 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 43 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 43 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 43 |
| 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 | 43 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 43 |
| 10.8 其他重大事件 | 47 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 48 |
| 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 | 48 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 48 |
| § 12 备查文件目录 | 48 |
| 12.1 备查文件目录 | 48 |
| 12.2 存放地点 | 49 |
| 12.3 查阅方式 | 49 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------------------------|
| 基金名称 | 景顺长城优选混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 景顺长城优选混合 |
| 场内简称 | 无 |
| 基金主代码 | 260101 |
| 系列基金名称 | 景顺长城景系列开放式证券投资基金 |
| 系列其他子基金名称 | 景顺长城货币(260102)、景顺长城动力平衡混合(260103) |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2003 年 10 月 24 日 |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,188,833,930.01 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金利用“景顺长城股票数据库”对股票进行精密和系统的分析，构建具有投资价值的股票组合，力求为投资者提供长期的资本增值。 |
| 投资策略 | 本基金采取“自下而上”结合“自上而下”的投资策略，以成长、价值及收益为基础，在合适的价位买入具有高成长性的成长型股票、价值被市场低估的价值型股票以及能提供稳定收益的收益型股票。 |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数×80%+中国债券总指数×20% |
| 风险收益特征 | 本基金是一种具有较高波动性和较高风险的投资工具，适合风险承受能力强、追求高投资回报的投资群体。 |

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 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 杨皞阳 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 |
| | 电子邮箱 | investor@igwfm.com |
| 客户服务电话 | 4008888606 | 95566 |
| 传真 | 0755-22381339 | 010-66594942 |
| 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 1 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 1 号 |
| 邮政编码 | 518048 | 100818 |
| 法定代表人 | 李进 | 葛海蛟 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.igwfm.com |

| | |
|------------|------------|
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |
|------------|------------|

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2024年1月1日-2024年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | -228,756,339.49 |
| 本期利润 | -585,137,142.18 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.4713 |
| 本期加权平均净值利润率 | -15.12% |
| 本期基金份额净值增长率 | -12.92% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 3,036,409,515.71 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 2.5541 |
| 期末基金资产净值 | 3,586,979,317.99 |
| 期末基金份额净值 | 3.0172 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 1,355.59% |

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、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

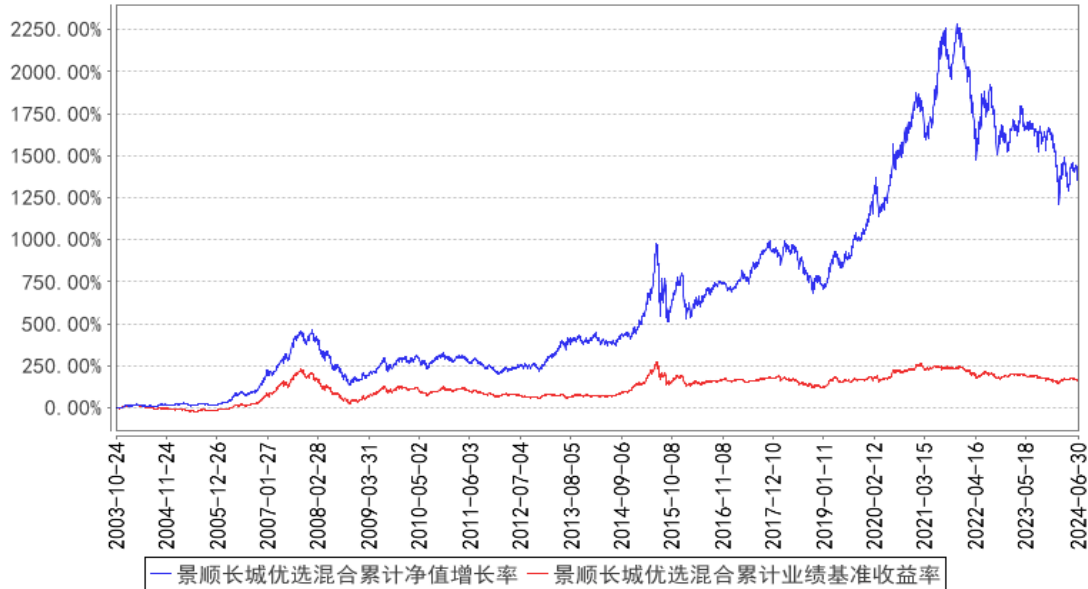
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | -3.30% | 0.95% | -3.21% | 0.45% | -0.09% | 0.50% |
| 过去三个月 | -2.61% | 1.19% | -2.25% | 0.66% | -0.36% | 0.53% |
| 过去六个月 | -12.92% | 1.55% | -0.56% | 0.82% | -12.36% | 0.73% |
| 过去一年 | -18.24% | 1.28% | -8.48% | 0.74% | -9.76% | 0.54% |

| | | | | | | |
|------------|-----------|-------|---------|-------|-----------|-------|
| 过去三年 | -32.08% | 1.28% | -24.17% | 0.83% | -7.91% | 0.45% |
| 自基金合同生效起至今 | 1,355.59% | 1.43% | 161.71% | 1.22% | 1,193.88% | 0.21% |

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

景顺长城优选混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的资产配置比例为：股票投资的比例为基金资产净值的 70%至 80%；债券投资的比例为基金资产净值的 20%至 30%。按照本系列基金基金合同的规定，本基金自 2003 年 10 月 24 日合同生效日起至 2004 年 1 月 23 日为建仓期。建仓期结束时，本基金投资组合均达到上述投资组合比例的要求。自 2017 年 9 月 6 日起，本基金业绩比较基准由“上证综合指数和深证综合指数的加权复合指数×80%+中国债券总指数×20%”调整为“中证 800 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 2024 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 184 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 | | |
| 杨锐文 | 本基金的基金经理 | 2014 年 10 月 25 日 | - | 14 年 | 工学硕士、理学硕士。曾任上海常春藤衍生投资公司分析部高级分析师。2010 年 11 月加入本公司，担任研究部研究员，自 2014 年 10 月起担任股票投资部基金经理，现任股票投资部执行总监、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、《景顺长城景系列开放式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 9 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

上半年，市场信心依然较弱，成长股承压，红利股占优。市场对成长风格带来巨大的挑战，尤其科创板表现不佳。

上半年，我们的基金表现依然较差，面临着前所未有的挑战。我们持有不少科创类的公司，市场杀估值力度超出我们预计，这段时间的困难与痛苦前所未有，但是，我们仍会坚持我们的选择和风格，也会不断优化和改进我们的持仓组合，希望不断通过企业的利润增长慢慢爬出这轮成长股的低谷。

我们过去一直是相对乐观派，但是，这轮成长股熊市的长度和深度远超出我们预期，这对我们的挑战也是前所未有的艰巨。我们投资的成长股的利润增长无法抵消估值下降，这轮成长股的负 beta 实在太剧烈了，这也让我们投资成长股的短期胜率大幅度下降，现时的市场对成长股的情绪也是前所未有的冰点。我们过去对市场风格的判断错误让组合吃尽苦头，哪怕我们不断积极的调整，局部的胜利无法弥补整体的下行。我内心也很难过，毕竟我也是多只本人管理基金的持有人。现状已如此，不少真成长股的估值也杀到原来难以想象的程度，我们只能争取一步一个脚印寻找真正高成长的个股，希望通过这些优质成长股的高成长性一步步收复失地。

尽管当下我们体感并不太好，但是，我们不少的新兴产业的确正在崛起，全产业链优势的雏形已现。尤其以我们的半导体产业为例，经过五年的打压之后不断加速前行，Mate 60 的推出更是说明了轻舟已过万重山。但是，现实中依然是“怀疑论”占据主基调，预期很难短期改变，只能依靠现实的推进不断改变预期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年上半年，本基金份额净值增长率为-12.92%，业绩比较基准收益率为-0.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球的 AI 产业依然如火如荼，但是，AI 应用的发展远没大家想象那么快，GPT 5.0 也迟迟未见身影。AI 技术的突破经过一轮快速的发展之后，似乎又进入新一轮的平台期。AI 并没有如大

家所愿一样线性增长或指数级增长，更大概率是阶梯式发展。这种情形是有利于中国企业快速追赶的。现在看，全球的 AI 应用型企业都在不断适配试图找出最佳的落地模式，但是，依旧还未找到突破式的应用场景。中国全社会都高度重视 AI 的发展，每个人都有很强烈的危机意识，也有大量的企业在投入与跟进，中国企业超强的迭代能力有望促使产业快速追赶。我们长期看好 AI 的发展，深信这个行业将会涌现出不少投资机会，我们未来也会投入大量的时间和精力扎根在这个行业的研究。但是，我们也不能对 AI 抱有不切实际的幻想。至今为止，AI 技术并没有大规模促进工业的发展，生成式 AI 所产生的幻觉与工业生产所要求的可预测性与可控性本质上是矛盾体，AI 改变社会将是漫长的过程，人们往往高估短期的发展。

面对前所未有的挑战，我们已经不敢把希望寄望于牛市归来的假设上，我们不会把投资建立在不确定的预测之上，不会盲目乐观和冒进，我们倾向于假定眼下即常态，然后在这样的常态尽可能地构建有独立成长逻辑的公司作为组合，以此应对复杂多变的市场。我们始终坚持认为，合理且有策略的应对要比拍脑袋的预测要重要得多，只有脚踏实地，才能行稳而致远。

关于基金的策略容量

我们现在管理的优选、环保优势和创新成长等三支基金均定位为全行业基金，主要采取之前季报所描述的企业生命力评估的方法论策略。它们不仅会投资在企业成长爆发阶段，也会有大量投资于陪伴企业成长的早中期阶段，市值分布从 30 亿至万亿不等，行业分布也较为分散，体现为多层次均衡式投资。

景顺长城成长龙头也定位为全行业基金，但是投资的企业会更偏重于大市值龙头成长股。

景顺长城公司治理基金和成长领航基金同样定位于均衡成长，但有较多仓位投资于以专精特新为代表的中小市值股票。

景顺长城改革机遇基金的持仓结构基本与公司治理、成长领航一致，唯一不同就是仓位，改革机遇的仓位计划会在 50-90%之间波动，大部分时间会在 60-70%之间。由于对市场相对乐观，改革机遇的仓位现阶段高于 80%。

景顺长城电子信息产业与新能源产业均是团队管理的行业型基金，分别聚焦于科技股与新能源产业。由于聚焦于科技股和新能源产业，这两个基金会体现较高的波动率。我们希望通过产业切入的方式实现持续的超额收益，并通过更专业的产业投资让投资者分享产业成长的红利。

我们不同的基金将会根据基金本身的规模、策略容量、申购赎回冲击力等因素制定申购限制，总体原则是希望基金规模相对平稳，避免规模急剧波动，这样可以确保申购赎回对基金的冲击尽可能小。

结束语

这半年是我从业以来最痛苦的时刻，或许这种极度难受的时刻意味着风格拐点的出现，但是，我们并不能把希望寄托于这些，我们还是希望自己持仓的企业通过不断地利润增长来实现股价的上涨，如果能有戴维斯双击就更好，哪怕没有，也要确保利润的增长速度快于估值下降的速度。这对我们的选股要求也是前所未有的，这个市场容不得我们犯太多的错误，我们努力做好基本面的研究和跟踪。在职业生涯最艰难的时刻，的确听到了无数的谩骂声，我能充分理解大家的抱怨，但是，让我更加感动的是，我也听到了很多鼓励和理解的声音，对此，我充满感恩之心。我努力做好，希望尽全力早日让所有持有人都能获得满意的回报，感谢各位持有人一直以来的信任与支持！

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

本基金本报告期内实施了一次利润分配。截至 2023 年 12 月 31 日，本基金可供分配利润为 3,966,324,517.31 元。本基金的基金管理人已于 2024 年 1 月 9 日完成权益登记，本基金每 10 份基金份额派发红利 0.1 元，详细信息请查阅相关分红公告。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城优选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：景顺长城优选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|-------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 104,354,954.30 | 90,471,842.80 |
| 结算备付金 | | 1,619,009.90 | 2,678,980.92 |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 存出保证金 | | 274,110.48 | 393,140.79 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 3,486,038,616.37 | 4,497,817,911.72 |
| 其中：股票投资 | | 2,733,097,430.10 | 3,563,401,898.74 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 752,941,186.27 | 934,416,012.98 |
| 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 | | 3,597,169.43 | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 3,247,833.14 | 1,389,333.63 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 3,599,131,693.62 | 4,592,751,209.86 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023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 | | 3,604,879.24 | 5,335,946.91 |
| 应付赎回款 | | 3,195,827.90 | 3,504,385.92 |
| 应付管理人报酬 | | 3,677,235.81 | 4,680,101.75 |
| 应付托管费 | | 612,872.62 | 780,016.93 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 4,948.10 | 4,948.10 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 1,056,611.96 | 2,397,889.20 |
| 负债合计 | | 12,152,375.63 | 16,703,288.81 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 550,569,802.28 | 609,723,403.74 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 3,036,409,515.71 | 3,966,324,517.31 |

| | | | |
|----------|--|------------------|------------------|
| 净资产合计 | | 3,586,979,317.99 | 4,576,047,921.05 |
| 负债和净资产总计 | | 3,599,131,693.62 | 4,592,751,209.86 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 3.0172 元，基金份额总额 1,188,833,930.01 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城优选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| 一、营业总收入 | | -558,068,070.72 | 463,819,001.91 |
| 1. 利息收入 | | 168,618.04 | 294,878.18 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 168,618.04 | 294,878.18 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -202,147,388.74 | -61,906,765.95 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -230,047,036.74 | -95,741,823.83 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 9,022,796.74 | 18,508,935.25 |
| 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 | 18,876,851.26 | 15,326,122.63 |
| 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 | -356,380,802.69 | 525,066,092.11 |
| 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 | 291,502.67 | 364,797.57 |
| 减：二、营业总支出 | | 27,069,071.46 | 44,038,708.66 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 23,075,443.53 | 37,609,423.20 |

| | | | |
|----------------------------|------------|-----------------|----------------|
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 3,845,907.26 | 6,268,237.17 |
| 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 | | - | 19.29 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 147,720.67 | 161,029.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -585,137,142.18 | 419,780,293.25 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -585,137,142.18 | 419,780,293.25 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -585,137,142.18 | 419,780,293.25 |

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城优选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|-------------------------------------|---------------------------------------|--------|------------------|------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 609,723,403.74 | - | 3,966,324,517.31 | 4,576,047,921.05 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 609,723,403.74 | - | 3,966,324,517.31 | 4,576,047,921.05 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -59,153,601.46 | - | -929,915,001.60 | -989,068,603.06 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -585,137,142.18 | -585,137,142.18 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -59,153,601.46 | - | -331,636,155.33 | -390,789,756.79 |
| 其中：1. 基金申购款 | 35,110,228.29 | - | 198,948,157.36 | 234,058,385.65 |

| | | | | |
|--|---------------------------------|--------|------------------|------------------|
| 2. 基金赎回款 | -94,263,829.75 | - | -530,584,312.69 | -624,848,142.44 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | -13,141,704.09 | -13,141,704.09 |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 550,569,802.28 | - | 3,036,409,515.71 | 3,586,979,317.99 |
| 项目 | 上年度可比期间 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 | 612,107,443.57 | - | 3,860,446,479.37 | 4,472,553,922.94 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 612,107,443.57 | - | 3,860,446,479.37 | 4,472,553,922.94 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 22,051,311.89 | - | 574,319,060.20 | 596,370,372.09 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 419,780,293.25 | 419,780,293.25 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列) | 22,051,311.89 | - | 154,538,766.95 | 176,590,078.84 |
| 其中：1. 基金申购款 | 102,022,554.41 | - | 714,887,169.34 | 816,909,723.75 |
| 2. 基金赎回款 | -79,971,242.52 | - | -560,348,402.39 | -640,319,644.91 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 634,158,755.46 | - | 4,434,765,539.57 | 5,068,924,295.03 |

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

景顺长城景系列开放式证券投资基金(以下简称“本系列基金”)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[2003]第 96 号《关于同意景顺长城景系列开放式证券投资基金设立的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 10 月 24 日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设三个子基金,分别为景顺长城优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)、景顺长城货币市场证券投资基金(2005 年 7 月 15 日前原为景顺长城恒丰债券证券投资基金)和景顺长城动力平衡证券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,835,000,215.28 元,其中包括本基金人民币 820,829,988.03 元、景顺长城恒丰债券证券投资基金人民币 473,468,816.63 元和景顺长城动力平衡证券投资基金人民币 540,701,410.62 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(2003)第 144 号验资报告予以验证。本系列基金设立募集期内认购资金产生的银行利息人民币 782,418.90 元在基金募集期结束时计入投资者认购账户,折合成 782,418.90 份基金份额,其中本基金 262,508.27 份基金份额、景顺长城恒丰债券证券投资基金 258,742.20 份基金份额和景顺长城动力平衡证券投资基金 261,168.43 份基金份额,归投资者所有。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《景顺长城景系列开放式证券投资基金招募说明书》和《景顺长城优选股票型证券投资基金基金份额拆分的公告》的有关规定,本基金于 2007 年 3 月 19 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 2.130676355,并于 2007 年 3 月 19 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》,景顺长城景系列开放式证券投资基金之景顺长城优选股票证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为景顺长城景系列开放式证券投资基金之景顺长城优选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括股票、债券以及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。股票投资范围包括所有在国内依法公开发行上市的 A 股及存托凭证;债券投资的范围包括国债、金融债、企业债与可转债等。在正常情况下,本基金的资产配置比例为:股票投资占基金资

产净值的 70%-80%，债券投资占基金资产净值的 20%-30%。本基金的原业绩比较基准为：上证综合指数和深证综合指数的加权复合指数 X80%+中国债券总指数 X20%。根据《景顺长城基金管理有限公司关于变更景顺长城优选混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同的公告》，本基金的业绩比较基准自 2017 年 9 月 6 日起变更为：中证 800 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 2024 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》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 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 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》、财税[2023]39号《关于减半征收交易印花税的公告》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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。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 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|-------------------|------------------------|
| 活期存款 | 104,354,954.30 |
| 等于：本金 | 104,342,195.06 |
| 加：应计利息 | 12,759.24 |
| 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 | 104,354,954.30 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|------------------------|----------------|------------------|-----------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 3,531,680,570.16 | - | 2,733,097,430.10 | -798,583,140.06 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | 741,779,395.00 | 9,783,186.27 | 752,941,186.27 |

| | | | | | |
|--------|----|------------------|--------------|------------------|-----------------|
| | 合计 | 741,779,395.00 | 9,783,186.27 | 752,941,186.27 | 1,378,605.00 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 4,273,459,965.16 | 9,783,186.27 | 3,486,038,616.37 | -797,204,535.06 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 3,602.16 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 964,146.68 |
| 其中：交易所市场 | 962,121.68 |
| 银行间市场 | 2,025.00 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 88,863.12 |
| 合计 | 1,056,611.96 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,316,560,156.60 | 609,723,403.74 |
| 本期申购 | 75,815,418.75 | 35,110,228.29 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -203,541,645.34 | -94,263,829.75 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 1,188,833,930.01 | 550,569,802.28 |

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 | 4,769,116,992.94 | -802,792,475.63 | 3,966,324,517.31 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 4,769,116,992.94 | -802,792,475.63 | 3,966,324,517.31 |
| 本期利润 | -228,756,339.49 | -356,380,802.69 | -585,137,142.18 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -452,502,874.91 | 120,866,719.58 | -331,636,155.33 |
| 其中：基金申购款 | 268,659,164.65 | -69,711,007.29 | 198,948,157.36 |
| 基金赎回款 | -721,162,039.56 | 190,577,726.87 | -530,584,312.69 |
| 本期已分配利润 | -13,141,704.09 | - | -13,141,704.09 |
| 本期末 | 4,074,716,074.45 | -1,038,306,558.74 | 3,036,409,515.71 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 152,447.31 |
| 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 | 13,919.38 |
| 其他 | 2,251.35 |
| 合计 | 168,618.04 |

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -230,047,036.74 |
| 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 | -230,047,036.74 |

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 |
|------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 1,267,806,818.40 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,494,915,035.63 |

| | |
|----------|-----------------|
| 减：交易费用 | 2,938,819.51 |
| 买卖股票差价收入 | -230,047,036.74 |

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 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 8,686,729.99 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 336,066.75 |
| 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 | 9,022,796.74 |

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 605,391,769.02 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 596,553,619.28 |
| 减：应计利息总额 | 8,497,932.99 |
| 减：交易费用 | 4,150.00 |
| 买卖债券差价收入 | 336,066.75 |

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 |
|---------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 18,876,851.26 |
| 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 | 18,876,851.26 |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | -356,380,802.69 |
| 股票投资 | -357,072,391.02 |
| 债券投资 | 691,588.33 |
| 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 | -356,380,802.69 |

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 264,931.57 |
| 基金转换费收入 | 26,571.10 |
| 合计 | 291,502.67 |

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 | |
|-----------|---------------------------------|------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
| 审计费用 | | 59,672.34 |
| 信息披露费 | | 19,890.78 |
| 证券出借违约金 | | - |
| 债券托管账户维护费 | | 18,900.00 |
| 银行划款手续费 | | 12,540.42 |
| 存托服务费 | | 36,717.13 |
| 合计 | | 147,720.67 |

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 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 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 | | 上年度可比期间 | |
|-------|---------------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 | 77,036,351.48 | 3.38 | 85,724,073.18 | 1.99 |

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024年1月1日至2024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 | 72,868.57 | 3.38 | 72,868.57 | 7.57 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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 | 79,835.41 | 1.98 | - | - |

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 2024年1月1日至2024年6 月30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日 |
|------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 23,075,443.53 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 5,845,802.13 | 9,200,193.94 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 17,229,641.40 | 28,409,229.26 |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

根据《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》，自 2023 年 8 月 22 日起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.2\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 |
|----|------------------------|----------------------------|
| | | |

| | 月 30 日 | 6 月 30 日 |
|----------------|--------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,845,907.26 | 6,268,237.17 |

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：

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

根据《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》，自 2023 年 8 月 22 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

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未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 |
| 中国银行-活期 | 104,354,954.30 | 152,447.31 | 206,351,076.01 | 273,360.35 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每 10 份 基金份 额分红 数 | 现金形式 发放总额 | 再投资形式 发放总额 | 本期利润分配 合计 | 备注 |
|----|-------------------|-----|-------------------|---------------------------|--------------|---------------|---------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2024 年 1 月 9 日 | - | 2024 年 1 月 9 日 | 0.1000 | 7,251,812.75 | 5,889,891.34 | 13,141,704.09 | - |
| 合计 | - | - | - | 0.1000 | 7,251,812.75 | 5,889,891.34 | 13,141,704.09 | - |

6.4.12 期末（2024 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 |
| 301392 | 汇成真空 | 2024 年 5 月 28 日 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 12.20 | 41.66 | 219 | 2,671.80 | 9,123.54 | - |
| 301502 | 华阳智能 | 2024 年 1 月 26 日 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 28.01 | 37.83 | 138 | 3,865.38 | 5,220.54 | - |
| 301538 | 骏鼎达 | 2024 年 3 月 13 日 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 55.82 | 91.24 | 107 | 5,972.74 | 9,762.68 | - |
| 301538 | 骏鼎达 | 2024 年 5 月 22 日 | 1-6 个 月(含) | 新股 流通 受限 | - | 91.24 | 43 | - | 3,923.32 | 转 增 股 |
| 301539 | 宏鑫科技 | 2024 年 4 月 3 日 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 10.64 | 19.82 | 361 | 3,841.04 | 7,155.02 | - |
| 301565 | 中仑新材 | 2024 年 6 月 13 日 | 6 个月 | 新股 流通 受限 | 11.88 | 18.98 | 711 | 8,446.68 | 13,494.78 | - |
| 301566 | 达利凯普 | 2023 年 12 月 22 | 6 个月 以上 | 新股 流通 | 8.90 | 16.97 | 576 | 5,126.40 | 9,774.72 | - |

| | | 日 | | 受限 | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|----------------------|-------|--------|---------|--------------|--------------|---|
| 301580 | 爱迪特 | 2024年6月19日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 44.95 | 65.93 | 202 | 9,079.90 | 13,317.86 | - |
| 301587 | 中瑞股份 | 2024年3月27日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 21.73 | 25.26 | 306 | 6,649.38 | 7,729.56 | - |
| 301588 | 美新科技 | 2024年3月6日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 14.50 | 21.25 | 257 | 3,726.50 | 5,461.25 | - |
| 688190 | 云路股份 | 2024年4月10日 | 6个月 | 询价 转让 流通 受限 | 70.58 | 71.42 | 100,000 | 7,058,000.00 | 7,142,000.00 | - |
| 688530 | 欧莱新材 | 2024年4月29日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 9.60 | 16.10 | 344 | 3,302.40 | 5,538.40 | - |
| 688691 | 灿芯股份 | 2024年4月2日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 19.86 | 42.51 | 247 | 4,905.42 | 10,499.97 | - |
| 688692 | 达梦数据 | 2024年6月4日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 86.96 | 174.93 | 175 | 15,218.00 | 30,612.75 | - |
| 688695 | 中创股份 | 2024年3月6日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 22.43 | 31.55 | 186 | 4,171.98 | 5,868.30 | - |
| 688709 | 成都华微 | 2024年1月31日 | 6个月 | 新股 流通 受限 | 15.69 | 18.79 | 1,045 | 16,396.05 | 19,635.55 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，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 2024年6月 30日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5 年 以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|--------------|------------------|------------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 104,354,954.30 | - | - | - | - | - | 104,354,954.30 |
| 结算备付金 | 1,619,009.90 | - | - | - | - | - | 1,619,009.90 |
| 存出保证金 | 274,110.48 | - | - | - | - | - | 274,110.48 |
| 交易性金融资产 | - | 285,490,256.83 | 262,554,208.13 | 204,896,721.31 | - | 2,733,097,430.10 | 3,486,038,616.37 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 3,247,833.14 | 3,247,833.14 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 3,597,169.43 | 3,597,169.43 |
| 资产总计 | 106,248,074.68 | 285,490,256.83 | 262,554,208.13 | 204,896,721.31 | - | 2,739,942,432.67 | 3,599,131,693.62 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 3,195,827.90 | 3,195,827.90 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 3,677,235.81 | 3,677,235.81 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 612,872.62 | 612,872.62 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 3,604,879.24 | 3,604,879.24 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 4,948.10 | 4,948.10 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 1,056,611.96 | 1,056,611.96 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 12,152,375.63 | 12,152,375.63 |
| 利率敏感度 缺口 | 106,248,074.68 | 285,490,256.83 | 262,554,208.13 | 204,896,721.31 | - | - | - |

| 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年 以 上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------------|----------------|---------------|----------------|-------|------------------|-------------------|------------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 90,471,842.80 | - | - | - | - | - | 90,471,842.80 |
| 结算备付金 | 2,678,980.92 | - | - | - | - | - | 2,678,980.92 |
| 存出保证金 | 393,140.79 | - | - | - | - | - | 393,140.79 |
| 交易性金融 资产 | 120,329,811.59 | 61,137,934.43 | 752,948,266.96 | - | - | -3,563,401,898.74 | 4,497,817,911.72 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 1,389,333.63 | 1,389,333.63 |
| 资产总计 | 213,873,776.10 | 61,137,934.43 | 752,948,266.96 | - | - | -3,564,791,232.37 | 4,592,751,209.86 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 3,504,385.92 | 3,504,385.92 |
| 应付管理人 报酬 | - | - | - | - | - | 4,680,101.75 | 4,680,101.75 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 780,016.93 | 780,016.93 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 5,335,946.91 | 5,335,946.91 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 4,948.10 | 4,948.10 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 2,397,889.20 | 2,397,889.20 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 16,703,288.81 | 16,703,288.81 |
| 利率敏感度 缺口 | 213,873,776.10 | 61,137,934.43 | 752,948,266.96 | - | - | - | - |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|--------------------|---------------------------------|---------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2024 年 6 月 30 日） | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -1,265,740.76 | -1,114,024.85 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 1,271,375.76 | 1,117,503.80 |

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 2024年6月30日 | | 上年度末 2023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 | 2,733,097,430.10 | 76.19 | 3,563,401,898.74 | 77.87 |
| 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 | 2,733,097,430.10 | 76.19 | 3,563,401,898.74 | 77.87 |

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（2024年6月30日） | 上年度末（2023年12月31日） |
| | 沪深 300 指数上升 5% | 185,261,997.60 | 157,743,192.67 |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -185,261,997.60 | -157,743,192.67 |

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 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 2,725,798,311.86 | 3,534,856,906.96 |
| 第二层次 | 752,950,960.99 | 958,489,157.43 |
| 第三层次 | 7,289,343.52 | 4,471,847.33 |
| 合计 | 3,486,038,616.37 | 4,497,817,911.72 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 2,733,097,430.10 | 75.94 |
| | 其中：股票 | 2,733,097,430.10 | 75.94 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 752,941,186.27 | 20.92 |
| | 其中：债券 | 752,941,186.27 | 20.92 |
| | 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 | 105,973,964.20 | 2.94 |
| 8 | 其他各项资产 | 7,119,113.05 | 0.20 |
| 9 | 合计 | 3,599,131,693.62 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,320,728,448.96 | 64.70 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 116,733,353.02 | 3.25 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 151,023,122.12 | 4.21 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 43,404,896.00 | 1.21 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 18,295,200.00 | 0.51 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 82,912,410.00 | 2.31 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,733,097,430.10 | 76.19 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 689009 | 九号公司 | 7,333,414 | 269,942,969.34 | 7.53 |
| 2 | 603737 | 三棵树 | 5,044,608 | 182,967,932.16 | 5.10 |
| 3 | 688120 | 华海清科 | 772,517 | 146,453,772.86 | 4.08 |
| 4 | 688213 | 思特威 | 2,962,815 | 143,696,527.50 | 4.01 |
| 5 | 688019 | 安集科技 | 1,136,923 | 143,024,913.40 | 3.99 |
| 6 | 688002 | 睿创微纳 | 4,342,289 | 121,453,823.33 | 3.39 |
| 7 | 300750 | 宁德时代 | 666,880 | 120,058,406.40 | 3.35 |
| 8 | 688114 | 华大智造 | 2,471,667 | 117,181,732.47 | 3.27 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|------------|----------------|------|
| 9 | 002352 | 顺丰控股 | 3,270,758 | 116,733,353.02 | 3.25 |
| 10 | 300567 | 精测电子 | 2,054,400 | 116,094,144.00 | 3.24 |
| 11 | 688301 | 奕瑞科技 | 949,862 | 109,452,598.26 | 3.05 |
| 12 | 688475 | 萤石网络 | 3,060,002 | 104,376,668.22 | 2.91 |
| 13 | 688220 | 翱捷科技 | 2,669,150 | 99,986,359.00 | 2.79 |
| 14 | 002044 | 美年健康 | 21,934,500 | 82,912,410.00 | 2.31 |
| 15 | 603596 | 伯特利 | 1,877,400 | 73,030,860.00 | 2.04 |
| 16 | 300207 | 欣旺达 | 4,676,297 | 70,939,425.49 | 1.98 |
| 17 | 688169 | 石头科技 | 160,703 | 63,091,997.80 | 1.76 |
| 18 | 300054 | 鼎龙股份 | 2,687,703 | 60,957,104.04 | 1.70 |
| 19 | 688378 | 奥来德 | 2,376,178 | 55,745,135.88 | 1.55 |
| 20 | 002371 | 北方华创 | 153,500 | 49,103,115.00 | 1.37 |
| 21 | 300384 | 三联虹普 | 3,308,300 | 43,404,896.00 | 1.21 |
| 22 | 688548 | 广钢气体 | 4,742,368 | 43,297,819.84 | 1.21 |
| 23 | 300666 | 江丰电子 | 897,195 | 42,670,594.20 | 1.19 |
| 24 | 688190 | 云路股份 | 561,947 | 41,654,060.37 | 1.16 |
| 25 | 688550 | 瑞联新材 | 1,657,466 | 38,436,636.54 | 1.07 |
| 26 | 300161 | 华中数控 | 1,613,890 | 36,296,386.10 | 1.01 |
| 27 | 688153 | 唯捷创芯 | 892,555 | 33,024,535.00 | 0.92 |
| 28 | 603931 | 格林达 | 1,613,508 | 32,802,617.64 | 0.91 |
| 29 | 300285 | 国瓷材料 | 1,743,600 | 31,123,260.00 | 0.87 |
| 30 | 688300 | 联瑞新材 | 546,447 | 26,284,100.70 | 0.73 |
| 31 | 603186 | 华正新材 | 1,081,604 | 25,720,543.12 | 0.72 |
| 32 | 301367 | 怡和嘉业 | 412,092 | 25,632,122.40 | 0.71 |
| 33 | 603005 | 晶方科技 | 905,000 | 18,443,900.00 | 0.51 |
| 34 | 000888 | 峨眉山 A | 1,680,000 | 18,295,200.00 | 0.51 |
| 35 | 300633 | 开立医疗 | 449,000 | 17,771,420.00 | 0.50 |
| 36 | 688484 | 南芯科技 | 196,216 | 7,279,613.60 | 0.20 |
| 37 | 688106 | 金宏气体 | 205,095 | 3,593,264.40 | 0.10 |
| 38 | 688692 | 达梦数据 | 175 | 30,612.75 | 0.00 |
| 39 | 688709 | 成都华微 | 1,045 | 19,635.55 | 0.00 |
| 40 | 301538 | 骏鼎达 | 150 | 13,686.00 | 0.00 |
| 41 | 301565 | 中仑新材 | 711 | 13,494.78 | 0.00 |
| 42 | 301580 | 爱迪特 | 202 | 13,317.86 | 0.00 |
| 43 | 688691 | 灿芯股份 | 247 | 10,499.97 | 0.00 |
| 44 | 301566 | 达利凯普 | 576 | 9,774.72 | 0.00 |
| 45 | 301392 | 汇成真空 | 219 | 9,123.54 | 0.00 |
| 46 | 301587 | 中瑞股份 | 306 | 7,729.56 | 0.00 |
| 47 | 301539 | 宏鑫科技 | 361 | 7,155.02 | 0.00 |
| 48 | 301578 | 辰奕智能 | 154 | 6,093.78 | 0.00 |
| 49 | 688695 | 中创股份 | 186 | 5,868.30 | 0.00 |
| 50 | 688530 | 欧莱新材 | 344 | 5,538.40 | 0.00 |
| 51 | 301588 | 美新科技 | 257 | 5,461.25 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 52 | 301502 | 华阳智能 | 138 | 5,220.54 | 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 | 688301 | 奕瑞科技 | 141,025,520.33 | 3.08 |
| 2 | 603737 | 三棵树 | 79,606,495.40 | 1.74 |
| 3 | 688114 | 华大智造 | 59,496,056.15 | 1.30 |
| 4 | 002387 | 维信诺 | 52,721,287.91 | 1.15 |
| 5 | 688550 | 瑞联新材 | 45,103,770.27 | 0.99 |
| 6 | 688190 | 云路股份 | 44,047,753.35 | 0.96 |
| 7 | 300384 | 三联虹普 | 43,904,203.04 | 0.96 |
| 8 | 300285 | 国瓷材料 | 34,549,411.00 | 0.76 |
| 9 | 688120 | 华海清科 | 31,901,373.39 | 0.70 |
| 10 | 688037 | 芯源微 | 30,395,301.20 | 0.66 |
| 11 | 688220 | 翱捷科技 | 28,568,860.26 | 0.62 |
| 12 | 300750 | 宁德时代 | 27,656,215.81 | 0.60 |
| 13 | 603596 | 伯特利 | 27,101,395.64 | 0.59 |
| 14 | 603186 | 华正新材 | 27,016,301.13 | 0.59 |
| 15 | 000888 | 峨眉山 A | 25,911,762.90 | 0.57 |
| 16 | 002044 | 美年健康 | 23,281,472.00 | 0.51 |
| 17 | 300207 | 欣旺达 | 23,234,268.78 | 0.51 |
| 18 | 300567 | 精测电子 | 22,685,187.21 | 0.50 |
| 19 | 688484 | 南芯科技 | 22,170,952.85 | 0.48 |
| 20 | 688372 | 伟测科技 | 22,054,547.10 | 0.48 |

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 | 688169 | 石头科技 | 186,510,506.57 | 4.08 |
| 2 | 688012 | 中微公司 | 91,391,571.71 | 2.00 |
| 3 | 002387 | 维信诺 | 88,636,894.61 | 1.94 |
| 4 | 000625 | 长安汽车 | 72,051,263.35 | 1.57 |
| 5 | 688007 | 光峰科技 | 58,458,755.99 | 1.28 |
| 6 | 688153 | 唯捷创芯 | 57,285,535.79 | 1.25 |
| 7 | 688037 | 芯源微 | 55,961,458.42 | 1.22 |
| 8 | 688425 | 铁建重工 | 49,368,995.03 | 1.08 |
| 9 | 688300 | 联瑞新材 | 47,574,956.73 | 1.04 |
| 10 | 300633 | 开立医疗 | 45,509,860.00 | 0.99 |
| 11 | 688521 | 芯原股份 | 44,880,199.55 | 0.98 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 12 | 688372 | 伟测科技 | 44,451,520.47 | 0.97 |
| 13 | 601208 | 东材科技 | 44,011,413.05 | 0.96 |
| 14 | 688305 | 科德数控 | 31,181,116.02 | 0.68 |
| 15 | 002044 | 美年健康 | 29,874,668.00 | 0.65 |
| 16 | 603186 | 华正新材 | 27,898,691.73 | 0.61 |
| 17 | 688103 | 国力股份 | 27,250,301.54 | 0.60 |
| 18 | 600206 | 有研新材 | 27,105,131.60 | 0.59 |
| 19 | 688106 | 金宏气体 | 25,527,229.43 | 0.56 |
| 20 | 603103 | 横店影视 | 23,134,932.60 | 0.51 |

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 | 1,021,682,958.01 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,267,806,818.40 |

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 | 752,941,186.27 | 20.99 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 752,941,186.27 | 20.99 |

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 | 230020 | 23 付息国债 20 | 2,000,000 | 204,896,721.31 | 5.71 |
| 2 | 210012 | 21 付息国债 12 | 1,400,000 | 143,142,770.49 | 3.99 |
| 3 | 220020 | 22 付息国债 20 | 1,400,000 | 142,347,486.34 | 3.97 |
| 4 | 220011 | 22 付息国债 11 | 1,000,000 | 100,827,068.49 | 2.81 |
| 5 | 220028 | 22 付息国债 28 | 800,000 | 81,258,032.79 | 2.27 |

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**

三棵树涂料股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方海关的处罚。

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 | 274,110.48 |
| 2 | 应收清算款 | 3,597,169.43 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 3,247,833.14 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 7,119,113.05 |
|---|----|--------------|

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 (%) |
| 214,061 | 5,553.72 | 252,323,932.88 | 21.22 | 936,509,997.13 | 78.78 |

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 | 47,014.09 | 0.003955 |

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、基金投资和研发部门 负责人持有本开放式基金 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | - |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日 (2003 年 10 月 24 日) 基金份额总额 | 821,092,496.30 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,316,560,156.60 |
| 本报告期基金总申购份额 | 75,815,418.75 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 203,541,645.34 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,188,833,930.01 |

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：

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------------|--------|------------------|------------------|--------------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1 | 1,089,910,862.79 | 47.77 | 1,031,106.73 | 47.77 | - |
| 中国国际 | 2 | 556,120,767.33 | 24.37 | 526,265.95 | 24.38 | - |

| | | | | | | |
|--------------|---|---------------|------|-----------|------|---|
| 金融股份有限公司 | | | | | | |
| 华西证券股份有限公司 | 1 | 98,190,642.54 | 4.30 | 92,879.38 | 4.30 | - |
| 浙商证券股份有限公司 | 1 | 84,330,846.97 | 3.70 | 79,768.02 | 3.70 | - |
| 东方证券股份有限公司 | 1 | 78,733,282.30 | 3.45 | 74,474.67 | 3.45 | - |
| 长城证券股份有限公司 | 1 | 77,036,351.48 | 3.38 | 72,868.57 | 3.38 | - |
| 中银国际证券股份有限公司 | 1 | 73,619,482.95 | 3.23 | 69,637.93 | 3.23 | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | 70,559,800.63 | 3.09 | 66,744.25 | 3.09 | - |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | 62,715,561.37 | 2.75 | 59,322.33 | 2.75 | - |
| 中泰证券股份有限公司 | 1 | 42,915,124.10 | 1.88 | 40,593.98 | 1.88 | - |
| 广发证券股份有限公司 | 2 | 38,978,486.12 | 1.71 | 36,869.71 | 1.71 | - |
| 信达证券股份有限公司 | 1 | 8,439,555.00 | 0.37 | 7,982.80 | 0.37 | - |
| 东吴证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------------|---|---|---|---|---|---|
| 中信证券 股份有限 公司 | 3 | - | - | - | - | - |
|--------------------|---|---|---|---|---|---|

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(%) |
| 国泰君安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 浙商证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------------|---|---|---|---|---|---|
| 华宝证券 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证 券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|--------------|-----------------|
| 1 | 关于景顺长城优选混合型证券投资基金暂停接受伍佰万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 1 月 8 日 |
| 2 | 景顺长城优选混合型证券投资基金分红公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 1 月 8 日 |
| 3 | 关于景顺长城优选混合型证券投资基金恢复接受伍佰万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 1 月 10 日 |
| 4 | 景顺长城基金管理有限公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 1 月 10 日 |
| 5 | 景顺长城基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 1 月 19 日 |
| 6 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 1 月 22 日 |
| 7 | 景顺长城优选混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 1 月 22 日 |
| 8 | 景顺长城基金管理有限公司关于终止华融融达期货股份有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 2 月 8 日 |
| 9 | 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 | 2024 年 3 月 22 日 |
| 10 | 关于警惕假冒景顺长城基金 APP 开展诈骗活动的声明 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 3 月 27 日 |
| 11 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 3 月 29 日 |
| 12 | 景顺长城优选混合型证券投资基金 | 中国证监会指定报刊及 | 2024 年 3 月 29 日 |

| | | | |
|----|---|--------------|-----------------|
| | 2023 年年度报告 | 网站 | |
| 13 | 关于景顺长城优选混合型证券投资基金暂停接受贰仟万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 4 月 10 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 | 2024 年 4 月 13 日 |
| 15 | 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 | 2024 年 4 月 15 日 |
| 16 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 4 月 22 日 |
| 17 | 景顺长城优选混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 4 月 22 日 |
| 18 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增汇丰银行为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 4 月 29 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 | 2024 年 5 月 24 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 | 2024 年 5 月 31 日 |
| 21 | 景顺长城优选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 6 月 14 日 |
| 22 | 景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 6 月 21 日 |
| 23 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024 年 6 月 29 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

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城景系列开放式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城景系列开放式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城景系列开放式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

2024 年 8 月 30 日