

# 景顺长城量化港股通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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	14
6.4 报表附注 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	35
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 .....	35
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 .....	40
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 .....	40
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 .....	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	40
7.12 投资组合报告附注 .....	41
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>42</b>
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
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>42</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	42
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
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>49</b>
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 .....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	50
12.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化港股通股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城量化港股通股票
基金主代码	006106
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 19 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	41,683,522.19 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过量化模型精选股票，在严格控制风险的前提下，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>本基金的投资策略主要包括：</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>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</p> <p>本基金主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。本基金的量化投资主要依据基本面投资原则构建投资组合，控制对市场的冲击，而非单一趋势性交易或程序化交易。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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> <p>4、股指期货、国债期货投资策略</p> <p>本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。</p> <p>5、中小企业私募债券的投资策略</p> <p>对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金将加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能</p>

	对发行人进行充分详尽的调研和分析。 6、资产支持证券的投资策略 本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，考虑选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	中证港股通综合指数收益率*85%+银行活期存款利率(税后)*15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中风险程度较高的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。 本基金还可在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	杨皞阳	郭明
	联系电话	0755-82370388	(010) 66105799
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@icbc.com.cn
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	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(2023年1月1日-2023年6月30日)
本期已实现收益	1,806,994.72
本期利润	740,401.84
加权平均基金份额本期利润	0.0160
本期加权平均净值利润率	1.80%
本期基金份额净值增长率	-0.47%
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	-5,292,170.66
期末可供分配基金份额利润	-0.1270
期末基金资产净值	36,391,351.53
期末基金份额净值	0.8730
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	-12.70%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

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

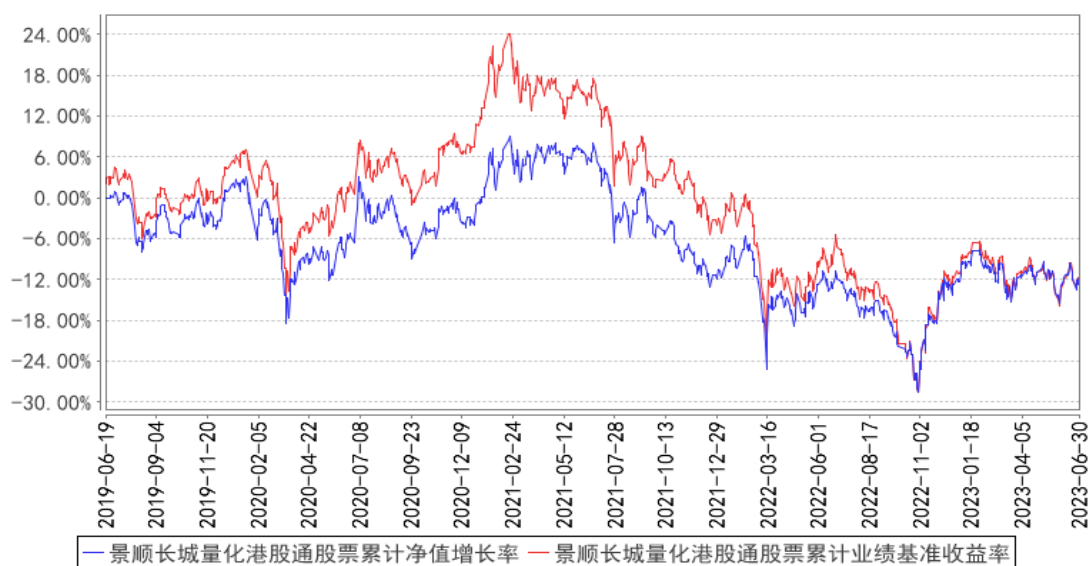
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	3.33%	1.02%	4.41%	0.97%	-1.08%	0.05%
过去三个月	-1.11%	0.92%	-1.03%	0.91%	-0.08%	0.01%
过去六个月	-0.47%	1.01%	-1.05%	0.96%	0.58%	0.05%
过去一年	-0.99%	1.17%	-5.21%	1.20%	4.22%	-0.03%
过去三年	-6.82%	1.19%	-12.72%	1.23%	5.90%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-12.70%	1.19%	-12.07%	1.22%	-0.63%	-0.03%

### 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

景顺长城量化港股通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：基金的投资组合比例为：本基金投资组合中投资于港股通标的股票的比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者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；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自2019年6月19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。自2019年9月6日，本基金的业绩比较基准由“中证港股通综合指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%”调整为“中证港股通综合指数收益率\*85%+银行活期存款利率(税后)\*15%”。

### 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		
周春泉	本基金的基金经理	2021 年 1 月 7 日	-	11 年	管理学博士，CFA。曾任海通国际证券集团资产管理部量化分析师、股票衍生品部量化分析师、资产管理部分析师，中泰金融国际有限公司资产管理部副总裁、基金经理。2018 年 10 月加入本公司，担任专户投资部投资经理，自 2021 年 1 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 11 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、《景顺长城量化港股通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 年年初，市场对国内经济修复的预期较高，随后的发展显示国内经济呈弱复苏态势。海外方面，超预期的通胀和经济数据使得美联储进一步加息的预期升温。在这样的大背景下，港股市场震荡回落。上半年，港股综指下跌 5.10%，恒指、国企指数、恒生科技指数分别下跌 4.37%、4.18%、5.27%。其中医疗、地产的回撤相对较大；而电讯、能源获得正收益。

#### 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-0.47%，业绩比较基准收益率为-1.05%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，预计国内经济仍将延续复苏趋势，政府可能会出台一些有针对性的经济刺激政策，来促进内需。美联储当前政策利率水平已经高于通胀水平，预计加息将进入尾声。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。目前港股市场整体估值已进入长期价值配置区间，伴随经济复苏和海外利率下行，港股有望迎来盈利与估值双重修复的机会。

本基金主要以基本面量化选股为主，风格上维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生成长稳健的公司，在股市波动中通过自下而上选股以期产生持续稳定的超额收益。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

有人的合法权益。

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性、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

从 2023 年 2 月 1 日至 2023 年 4 月 13 日，从 2023 年 4 月 21 日至 2023 年 6 月 30 日，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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：景顺长城量化港股通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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,832,988.02	23,196,993.66
结算备付金		13.73	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	30,443,948.34	44,923,408.13
其中：股票投资		30,443,948.34	44,923,408.13
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		368,711.04	1,716.00
应收申购款		1,514.31	4,512.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		36,647,175.44	68,126,630.02

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
<b>负 债:</b>			
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		6.69	12,684,922.90
应付赎回款		40,529.01	8,338.47
应付管理人报酬		45,320.00	49,415.40
应付托管费		7,553.32	8,235.91
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	162,414.89	83,473.60
负债合计		255,823.91	12,834,386.28
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	41,683,522.19	63,035,182.43
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-5,292,170.66	-7,742,938.69
净资产合计		36,391,351.53	55,292,243.74
负债和净资产总计		36,647,175.44	68,126,630.02

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8730 元，基金份额总额 41,683,522.19 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化港股通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
<b>一、营业总收入</b>		1,182,397.63	468,840.56
1. 利息收入		14,999.52	13,590.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	14,999.52	13,590.94
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）		2,040,751.11	-762,807.78
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,162,208.18	-1,630,403.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	999.73	-
股利收益	6.4.7.19	877,543.20	867,596.06
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	-1,066,592.88	987,092.93
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	193,239.88	230,964.47
<b>减：二、营业总支出</b>		441,995.79	408,413.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	309,514.67	285,042.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	51,585.75	47,507.13
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		3.62	-
8. 其他费用	6.4.7.23	80,891.75	75,864.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		740,401.84	60,426.85
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		740,401.84	60,426.85
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		740,401.84	60,426.85

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城量化港股通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)	63,035,182.43	-	-7,742,938.69	55,292,243.74
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)	63,035,182.43	-	-7,742,938.69	55,292,243.74
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-21,351,660.24	-	2,450,768.03	-18,900,892.21
(一)、综合收益总 额	-	-	740,401.84	740,401.84
(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)	-21,351,660.24	-	1,710,366.19	-19,641,294.05
其中: 1. 基金申购款	19,649,600.05	-	-2,144,797.74	17,504,802.31
2. 基金赎回 款	-41,001,260.29	-	3,855,163.93	-37,146,096.36
(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)	41,683,522.19	-	-5,292,170.66	36,391,351.53
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)	49,139,745.87	-	-5,212,641.73	43,927,104.14
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)	49,139,745.87	-	-5,212,641.73	43,927,104.14
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-8,654,952.09	-	424,579.62	-8,230,372.47
(一)、综合收益总 额	-	-	60,426.85	60,426.85
(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)	-8,654,952.09	-	364,152.77	-8,290,799.32
其中：1. 基金申购款	38,306,540.48	-	-4,782,093.33	33,524,447.15
2. 基金赎回 款	-46,961,492.57	-	5,146,246.10	-41,815,246.47
(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)	40,484,793.78	-	-4,788,062.11	35,696,731.67

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

景顺长城量化港股通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[2018]第 946 号《关于准予景顺长城量化港股通股票型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2018]3114 号《关于景顺长城量化港股通股票型证券投资基金延期募集备案的回函》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《景顺长城量化港股通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



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 222,207,070.19 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(2019)第 0316 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城量化港股通股票型证券投资基金基金合同》于 2019 年 6 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 222,337,194.36 份基金份额，其中认购资金利息折合 130,124.17 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《景顺长城量化港股通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具有良好流动性的金融工具，包括境内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债等)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规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)。本基金投资组合中投资于港股通标的股票的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需要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、应收申购款等。权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。根据《景顺长城基金管理有限公司关于调整景顺长城量化港股通股票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 2019 年 9 月 6 日起变更为：中证港股通综合指数收益率 X85%+银行活期存款利率(税后)X15%。本基金的原业绩比较基准为：中证港股通综合指数收益率 X95%+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	5,832,988.02
等于：本金	5,832,501.19
加：应计利息	486.83
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	5,832,988.02

#### 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	30,696,182.14	-	30,443,948.34	-252,233.80
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	30,696,182.14	-	30,443,948.34	-252,233.80

#### 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	151.49
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	42,920.24
其中：交易所市场	42,920.24
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	119,343.16
合计	162,414.89

## 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	63,035,182.43	63,035,182.43
本期申购	19,649,600.05	19,649,600.05
本期赎回 (以“-”号填列)	-41,001,260.29	-41,001,260.29
本期末	41,683,522.19	41,683,522.19

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	-5,590,210.58	-2,152,728.11	-7,742,938.69
本期利润	1,806,994.72	-1,066,592.88	740,401.84
本期基金份额交易产生的变动数	1,473,692.26	236,673.93	1,710,366.19
其中：基金申购款	-1,285,810.87	-858,986.87	-2,144,797.74
基金赎回款	2,759,503.13	1,095,660.80	3,855,163.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,309,523.60	-2,982,647.06	-5,292,170.66

#### 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	12,247.36
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	2,668.65
其他	83.51
合计	14,999.52

#### 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	1,162,208.18
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	1,162,208.18
----	--------------

## 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	87,052,025.31
减：卖出股票成本总额	85,484,910.95
减：交易费用	404,906.18
买卖股票差价收入	1,162,208.18

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	1,036.21
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	6.30

减：买卖权证差价收入应缴纳增值 税额	30.18
买卖权证差价收入	999.73

#### 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	877,543.20
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	877,543.20

#### 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	-1,066,592.88
股票投资	-1,066,592.88
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	-1,066,592.88

#### 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	193,239.88
合计	193,239.88

#### 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	19,835.79	
信息披露费	59,507.37	
证券出借违约金	-	
银行划款手续费	157.00	
证券组合费	1,391.59	
合计	80,891.75	

#### 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		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
长城证券	1,080,846.07	0.68	8,875,545.24	6.99

###### 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	864.67	0.68	-	-
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	7,100.67	6.99	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	309,514.67
其中：支付销售机构的客户维护费	58,526.24	49,301.82

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

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

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	51,585.75

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

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期	5,832,988.02	12,247.36	4,880,220.51	11,637.42

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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 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
00813	世茂集团	2022年4月 1日	重大事项停牌	0.00	2023年7月 31日	1.83	12,500	46,285.34	0.00	-
03333	中国恒大	2022年3月 21日	重大事项停牌	0.00	2023年8月 28日	0.20	20,000	26,949.96	0.00	-

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证券，不得超过该证券余额的 10%。

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日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	5,832,988.02	-	-	-	-	-	5,832,988.02
结算备付金	13.73	-	-	-	-	-	13.73

交易性金融资产	-	-	-	-	-	-30,443,948.34	30,443,948.34
应收股利	-	-	-	-	-	368,711.04	368,711.04
应收申购款	-	-	-	-	-	1,514.31	1,514.31
资产总计	5,833,001.75	-	-	-	-	-30,814,173.69	36,647,175.44
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	40,529.01	40,529.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	45,320.00	45,320.00
应付托管费	-	-	-	-	-	7,553.32	7,553.32
应付证券清算款	-	-	-	-	-	6.69	6.69
其他负债	-	-	-	-	-	162,414.89	162,414.89
负债总计	-	-	-	-	-	255,823.91	255,823.91
利率敏感度缺口	5,833,001.75	-	-	-	-	-	-
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	23,196,993.66	-	-	-	-	-	23,196,993.66
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-44,923,408.13	44,923,408.13
应收股利	-	-	-	-	-	1,716.00	1,716.00
应收申购款	-	-	-	-	-	4,512.23	4,512.23
资产总计	23,196,993.66	-	-	-	-	-44,929,636.36	68,126,630.02
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,338.47	8,338.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	49,415.40	49,415.40
应付托管费	-	-	-	-	-	8,235.91	8,235.91
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-12,684,922.90	12,684,922.90
其他负债	-	-	-	-	-	83,473.60	83,473.60
负债总计	-	-	-	-	-	-12,834,386.28	12,834,386.28
利率敏感度缺口	23,196,993.66	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	30,443,948.34	-	30,443,948.34
资产合计	-	30,443,948.34	-	30,443,948.34
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	30,443,948.34	-	30,443,948.34
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	44,923,408.13	-	44,923,408.13
资产合计	-	44,923,408.13	-	44,923,408.13
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	44,923,408.13	-	44,923,408.13

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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)
	所有外币相对人民币升值 5%	1,522,197.42	2,246,170.41
	所有外币相对人民币贬值 5%	-1,522,197.42	-2,246,170.41

#### 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	30,443,948.34	83.66	44,923,408.13	81.25
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	30,443,948.34	83.66	44,923,408.13	81.25

## 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%	1,731,489.95	2,752,891.18
	沪深300指数下降5%	-1,731,489.95	-2,752,891.18

## 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	30,443,948.34	44,727,576.55
第二层次	-	195,831.58

第三层次	-	-
合计	30,443,948.34	44,923,408.13

#### 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	30,443,948.34	83.07
	其中：股票	30,443,948.34	83.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,833,001.75	15.92

8	其他各项资产	370,225.35	1.01
9	合计	36,647,175.44	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 30,443,948.34 元，占基金资产净值的比例为 83.66%。

## 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

本基金本报告期末未持有境内股票投资。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	580,432.51	1.59
周期性消费品	3,919,377.99	10.77
非周期性消费品	3,818,260.31	10.49
综合	129,307.70	0.36
能源	999,822.78	2.75
金融	12,497,821.47	34.34
基金	-	-
工业	1,792,407.48	4.93
信息技术	271,984.10	0.75
公用事业	698,376.80	1.92
通讯	5,736,157.20	15.76
合计	30,443,948.34	83.66

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

## 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	00700	腾讯控股	10,400	3,179,577.11	8.74
2	00005	汇丰控股	31,600	1,777,208.65	4.88
3	03690	美团-W	9,470	1,067,819.72	2.93
4	01299	友邦保险	14,000	1,021,000.65	2.81
5	01211	比亚迪股份	3,500	806,732.50	2.22
6	02318	中国平安	17,500	804,312.30	2.21
7	03988	中国银行	274,378	794,329.03	2.18
8	01288	农业银行	279,000	792,275.85	2.18
9	00939	建设银行	148,000	691,816.91	1.90
10	01972	太古地产	37,800	671,227.26	1.84
11	01988	民生银行	248,500	664,424.89	1.83
12	01339	中国人民保险集团	237,000	620,566.30	1.71
13	03328	交通银行	118,000	564,638.99	1.55

14	01958	北京汽车	315,000	551,805.03	1.52
15	01883	中信国际电讯	182,000	503,401.08	1.38
16	09633	农夫山泉	12,400	494,457.87	1.36
17	01766	中国中车	122,000	482,545.89	1.33
18	02328	中国财险	58,000	465,765.86	1.28
19	00883	中国海洋石油	41,000	423,373.22	1.16
20	01448	福寿园	79,000	392,588.30	1.08
21	01099	国药控股	17,200	388,522.37	1.07
22	02611	国泰君安	45,000	381,284.83	1.05
23	01816	中广核电力	199,000	346,765.90	0.95
24	01513	丽珠医药	13,900	345,378.32	0.95
25	03958	东方证券	85,200	336,991.07	0.93
26	02202	万科企业	33,100	321,044.50	0.88
27	02233	西部水泥	436,000	317,566.79	0.87
28	03800	协鑫科技	190,000	317,068.92	0.87
29	00941	中国移动	5,272	311,326.46	0.86
30	01024	快手-W	6,300	311,043.78	0.85
31	02020	安踏体育	4,200	309,978.90	0.85
32	02009	金隅集团	380,000	301,303.06	0.83
33	02899	紫金矿业	28,000	296,877.56	0.82
34	06862	海底捞	18,000	286,108.83	0.79
35	00016	新鸿基地产	3,000	272,998.28	0.75
36	02359	药明康德	4,580	263,916.78	0.73
37	02378	保诚	2,550	251,797.35	0.69
38	01336	新华保险	12,800	243,697.75	0.67
39	06049	保利物业	6,800	237,926.16	0.65
40	06110	滔搏	38,000	237,889.28	0.65
41	03998	波司登	76,000	231,232.58	0.64
42	02338	潍柴动力	21,000	222,270.94	0.61
43	02669	中海物业	30,000	218,232.67	0.60
44	01997	九龙仓置业	6,000	216,573.10	0.60
45	09997	康基医疗	27,000	206,864.65	0.57
46	01686	新意网集团	55,000	202,835.60	0.56
47	02628	中国人寿	16,000	192,656.94	0.53
48	09979	绿城管理控股	33,000	189,245.61	0.52
49	03933	联邦制药	30,000	180,892.48	0.50
50	03969	中国通号	65,000	177,388.95	0.49
51	06600	赛生药业	18,000	174,918.05	0.48
52	03618	重庆农村商业银行	67,000	171,110.27	0.47
53	00386	中国石油化工股份	40,000	169,275.53	0.47
54	02150	奈雪的茶	31,500	157,409.65	0.43
55	01810	小米集团-W	15,000	148,254.38	0.41

56	03606	福耀玻璃	4,800	143,386.33	0.39
57	01071	华电国际电力股份	36,000	135,752.34	0.37
58	01818	招金矿业	15,000	135,254.47	0.37
59	02688	新奥能源	1,500	134,977.87	0.37
60	00151	中国旺旺	27,000	129,445.99	0.36
61	00267	中信股份	15,000	129,307.70	0.36
62	09987	百胜中国	300	122,143.91	0.34
63	06160	百济神州	1,200	118,824.78	0.33
64	00669	创科实业	1,500	117,759.90	0.32
65	03320	华润医药	18,500	116,326.22	0.32
66	03968	招商银行	3,500	114,878.71	0.32
67	03918	金界控股	30,000	114,233.32	0.31
68	03888	金山软件	4,000	113,772.33	0.31
69	02888	渣打集团	1,750	108,747.54	0.30
70	01361	361度	31,000	106,608.55	0.29
71	00867	康哲药业	9,000	105,880.18	0.29
72	00241	阿里健康	24,000	104,220.62	0.29
73	01515	华润医疗	18,500	102,510.35	0.28
74	00688	中国海外发展	6,500	102,358.22	0.28
75	03669	永达汽车	28,000	101,712.83	0.28
76	02015	理想汽车-W	800	99,942.63	0.27
77	00683	嘉里建设	6,500	97,324.21	0.27
78	01530	三生制药	12,500	90,699.78	0.25
79	01787	山东黄金	6,750	88,869.65	0.24
80	00303	VTECH HOLDINGS	1,800	85,301.59	0.23
81	00998	中信银行	25,000	84,822.16	0.23
82	02727	上海电气	48,000	80,986.72	0.22
83	00992	联想集团	10,000	75,325.77	0.21
84	06865	福莱特玻璃	3,000	73,988.90	0.20
85	00152	深圳国际	10,000	63,616.62	0.17
86	01112	H&H 国际控股	6,500	60,408.13	0.17
87	00189	东岳集团	11,000	59,430.83	0.16
88	06618	京东健康	1,250	56,989.89	0.16
89	00921	海信家电	3,000	55,595.39	0.15
90	02005	石四药集团	12,000	55,318.80	0.15
91	02273	固生堂	1,200	54,986.89	0.15
92	00388	香港交易所	200	54,433.70	0.15
93	00489	东风集团股份	16,000	52,811.01	0.15
94	01186	中国铁建	9,500	50,450.75	0.14
95	01209	华润万象生活	1,400	50,211.03	0.14
96	03898	时代电气	1,800	48,459.27	0.13
97	01876	百威亚太	2,600	48,422.39	0.13

98	01929	周大福	3,600	46,733.32	0.13
99	00027	银河娱乐	1,000	45,822.41	0.13
100	00667	中国东方教育	15,500	43,014.98	0.12
101	00995	安徽皖通高速公路	6,000	41,876.33	0.12
102	02601	中国太保	2,200	41,074.21	0.11
103	02400	心动公司	2,200	39,958.61	0.11
104	00392	北京控股	1,500	39,207.20	0.11
105	02367	巨子生物	1,200	38,501.88	0.11
106	00520	呷哺呷哺	11,000	37,321.75	0.10
107	00884	旭辉控股集团	48,000	33,633.83	0.09
108	00123	越秀地产	4,000	33,596.95	0.09
109	01585	雅迪控股	2,000	32,859.37	0.09
110	00836	华润电力	2,000	32,638.09	0.09
111	09923	移卡	2,000	32,269.30	0.09
112	01415	高伟电子	2,000	26,700.54	0.07
113	01066	威高股份	2,800	26,435.01	0.07
114	00960	龙湖集团	1,500	26,331.75	0.07
115	01675	亚信科技	2,400	24,119.00	0.07
116	00081	中国海外宏洋集团	7,000	23,685.67	0.07
117	00839	中教控股	4,000	22,496.31	0.06
118	01928	金沙中国有限公司	800	19,693.49	0.05
119	00981	中芯国际	1,000	18,808.39	0.05
120	06689	洪九果品	1,100	18,133.50	0.05
121	02282	美高梅中国	2,000	16,853.79	0.05
122	06078	海吉亚医疗	400	15,636.78	0.04
123	00817	中国金茂	14,000	14,843.88	0.04
124	01093	石药集团	2,000	12,557.37	0.03
125	00548	深圳高速公路股份	2,000	12,317.65	0.03
126	01896	猫眼娱乐	1,800	11,899.07	0.03
127	09922	九毛九	1,000	11,838.22	0.03
128	01833	平安好医生	600	10,477.38	0.03
129	00857	中国石油股份	2,000	9,994.26	0.03
130	00902	华能国际电力股份	2,000	9,035.40	0.02
131	00175	吉利汽车	1,000	8,814.13	0.02
132	01799	新特能源	400	6,121.95	0.02
133	06127	昭衍新药	200	3,632.60	0.01
134	00813	世茂集团	12,500	0.00	0.00
134	03333	中国恒大	20,000	0.00	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	01299	友邦保险	1,429,361.40	2.59
2	03690	美团-W	1,111,917.26	2.01
3	01211	比亚迪股份	1,082,965.39	1.96
4	02318	中国平安	1,068,823.72	1.93
5	01339	中国人民保险集团	1,058,161.22	1.91
6	00388	香港交易所	1,047,309.73	1.89
7	00883	中国海洋石油	997,150.30	1.80
8	02628	中国人寿	956,615.68	1.73
9	01988	民生银行	947,500.95	1.71
10	01816	中广核电力	922,545.06	1.67
11	03988	中国银行	875,881.88	1.58
12	01883	中信国际电讯	813,336.72	1.47
13	03328	交通银行	782,056.08	1.41
14	02899	紫金矿业	759,181.94	1.37
15	01099	国药控股	751,887.19	1.36
16	09987	百胜中国	745,925.79	1.35
17	01958	北京汽车	734,391.74	1.33
18	01972	太古地产	686,388.79	1.24
19	02338	潍柴动力	675,372.31	1.22
20	01997	九龙仓置业	665,823.87	1.20

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	01299	友邦保险	2,730,204.16	4.94
2	00700	腾讯控股	2,716,445.66	4.91
3	03690	美团-W	2,497,973.55	4.52
4	00005	汇丰控股	1,583,829.33	2.86
5	00388	香港交易所	1,329,452.99	2.40
6	02318	中国平安	1,203,590.48	2.18
7	00939	建设银行	1,164,746.97	2.11
8	01339	中国人民保险集团	1,113,596.11	2.01
9	00883	中国海洋石油	1,110,918.42	2.01
10	00006	电能实业	1,073,465.88	1.94
11	01211	比亚迪股份	1,018,139.10	1.84
12	00941	中国移动	1,012,829.66	1.83

13	00083	信和置业	1,011,908.52	1.83
14	03969	中国通号	923,298.08	1.67
15	01109	华润置地	897,715.81	1.62
16	02628	中国人寿	824,463.18	1.49
17	01088	中国神华	821,403.80	1.49
18	03988	中国银行	810,877.94	1.47
19	01766	中国中车	795,065.53	1.44
20	06160	百济神州	783,700.99	1.42

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	71,774,273.09
卖出股票收入（成交）总额	87,052,025.31

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产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

本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交



易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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。

中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会及其派出机构的处罚。

中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	368,711.04
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,514.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	370,225.35

### 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 (%)
1,259	33,108.44	20,018,000.00	48.02	21,665,522.19	51.98

### 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	237,062.84	0.568721

### 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	-
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 (2019 年 6 月 19 日) 基金份额总额	222,337,194.36
本报告期期初基金份额总额	63,035,182.43
本报告期基金总申购份额	19,649,600.05
减：本报告期基金总赎回份额	41,001,260.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	41,683,522.19

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**

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况****10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

**10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投证券股份有限公司	2	29,763,080.48	18.74	23,810.51	18.74	-
兴业证券股份有限公司	2	19,120,156.97	12.04	15,296.02	12.04	-
中信证券股份有限公司	3	16,048,902.97	10.10	12,839.57	10.10	-
国海证券股份有限公司	1	15,264,541.41	9.61	12,212.42	9.61	-
海通证券股份有限公司	1	14,194,519.81	8.94	11,355.74	8.94	-
广发证券股份	2	11,572,870.24	7.29	9,258.82	7.29	-

有限公司						
方正证券股份 有限公司	1	9,746,761.12	6.14	7,797.02	6.14	-
瑞银证券有限 责任公司	2	8,771,573.31	5.52	7,017.34	5.52	-
招商证券股份 有限公司	3	8,542,962.14	5.38	6,834.44	5.38	-
安信证券股份 有限公司	2	7,423,408.63	4.67	5,938.74	4.67	-
中泰证券股份 有限公司	1	6,086,381.90	3.83	4,869.07	3.83	-
中国国际金融 股份有限公司	2	5,579,097.81	3.51	4,463.37	3.51	-
国盛证券有限 责任公司	1	5,239,894.93	3.30	4,192.69	3.30	-
长城证券股份 有限公司	2	1,080,846.07	0.68	864.67	0.68	-
太平洋证券股 份有限公司	2	391,300.61	0.25	313.00	0.25	-
第一创业证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方财富证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
高盛（中国） 证券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	本期报 告新增 1个
国都证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	本期报 告新增 1个
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
开源证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	本期报 告新增

						1 个
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞信证券（中国）有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中航证券股份有限公司	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 (%)
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有	-	-	-	-	-	-

限公司						
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	1,036.21	100.00
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有	-	-	-	-	-	-

限公司						
华创证券有限责 任公司	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
瑞信证券(中国) 有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证 券有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券股份有 限公司	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年非港股通交易日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回及转换业务安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 4 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 17 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
4	景顺长城量化港股通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
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中欧财富为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 8 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 10 日
7	关于景顺长城量化港股通股票型证券投资基金新增江海证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 23 日

	告		
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 2 月 24 日
9	关于旗下部分基金在 2023 年度新增港股通交易日照常开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 6 日
10	关于景顺长城量化港股通股票型证券投资基金新增腾安基金为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 24 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 25 日
12	景顺长城量化港股通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
13	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
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 6 日
15	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
16	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
17	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
18	景顺长城量化港股通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
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 22 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 6 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 5 月 13 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 23 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 27 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 10 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 17 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2023 年 6 月 22 日



停机维护的公告	网站
---------	----

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101-20230630	20,018,000.00	0.00	0.00	20,018,000.00	48.02
	2	20230414-20230420	0.00	16,852,808.98	16,852,808.98	0.00	0.00
	3	20230101-20230131	18,149,744.75	0.00	18,149,744.75	0.00	0.00

#### 产品特有风险

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

#### 1、大额申购风险

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

#### 2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

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

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

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

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

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

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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足投资者的理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》等法律法规的规定和《景顺长城量化港股通股票型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2023 年 7 月 11

日起对景顺长城量化港股通股票型证券投资基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额，同时对《基金合同》和《托管协议》进行了相应的修改。详情请参阅本基金管理人于 2023 年 7 月 11 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城量化港股通股票型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同、托管协议部分条款的公告》。

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港股通股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城量化港股通股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城量化港股通股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城量化港股通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