

景顺长城标普消费精选交易型开放式指数  
证券投资基金（QDII）  
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 24 日（基金合同生效日）起至 2024 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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
<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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9 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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
<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.....	14
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	38

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	43
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	45
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	45
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	45
7.11 投资组合报告附注 .....	45
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	47
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</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 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)
基金简称	景顺长城标普消费精选 ETF (QDII)
场内简称	标普消费 ETF
基金主代码	159529
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 1 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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	60,536,791.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 2 月 2 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金采用完全复制法跟踪标的指数，即原则上按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当市场出现流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，基金管理人认定不适合投资的股票等情况导致本基金无法按照指数构成及权重进行组合构建时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股、公募基金、其他衍生品进行替代，并以降低跟踪误差为目标，优化投资组合的配置结构。在进行替代投资时，本基金所持有基金或金融衍生品应符合相关投资比例的限制。</p> <p>本基金在投资的过程中，由于必须保有一定比例的现金资产，导致在市場上漲的过程中，基金投资组合的表现可能会落后于标的指数的表现。另外，由于基金投资组合权重与目标指数成份股权重的不一致、股票买卖价格与股票收盘价的差异、指数成份股的调整与指数成份股权重的调整所产生的交易费用、基金运作过程中的各项费用与开支都会使基金投资组合产生跟踪误差。基金管理人会定期对跟踪误差进行归因分析，为基金投资组合下一步的调整及跟踪目标指数偏离风险的控制提供量化决策依据。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。</p>
业绩比较基准	标普 500 消费精选指数收益率（使用估值汇率调整）
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p> <p>本基金投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的</p>

	市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。
--	--

## 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	杨崑阳	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	廖林

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	HSBC
	中文	-	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		-	香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		-	香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼
邮政编码		-	-

## 2.5 信息披露方式

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

## 2.6 其他相关资料

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

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 24 日(基金合同生效日) - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,347,698.35
本期利润	11,302,626.10
加权平均基金份额本期利润	0.0944
本期加权平均净值利润率	9.17%
本期基金份额净值增长率	6.83%

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	4,132,209.73
期末可供分配基金份额利润	0.0683
期末基金资产净值	64,669,000.73
期末基金份额净值	1.0683
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	6.83%

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。

4、本基金基金合同生效日为2024年1月24日。

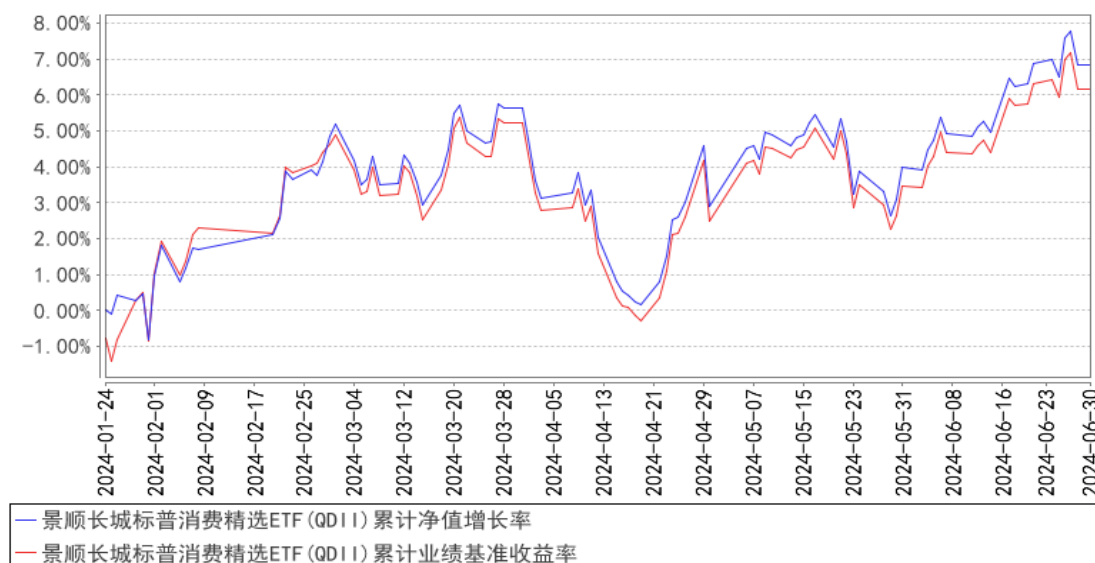
## 3.2 基金净值表现

### 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	2.75%	0.53%	2.61%	0.54%	0.14%	-0.01%
过去三个月	1.13%	0.70%	0.91%	0.70%	0.22%	0.00%
自基金合同生效起至今	6.83%	0.68%	6.18%	0.70%	0.65%	-0.02%

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

景顺长城标普消费精选ETF(QDII)累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的建仓期为自 2024 年 1 月 24 日基金合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2024 年 1 月 24 日）起至本报告期末不满一年。

### 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		
汪洋	本基金的基金经理	2024 年 1 月 24 日	-	16 年	理学硕士。曾任美国 KeyBank 利率衍生品部首席数量分析师，华泰联合证券股份有限公司金融工程部高级研究员，华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，汇添富基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理，博时基金管理有限公司指数与量化投资部副总经理兼基金经理。2021 年 10 月加入本公司，担任 ETF 与创新投资部总经理，自 2022 年 5 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理，现任 ETF 与创新投资部总经理、基金经理。具有 16 年证券、基金行业从业经验。
张晓南	本基金的基金助理	2024 年 1 月 26 日	-	14 年	经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020 年 2 月加入本公司，自 2020 年 4 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 14 年证券、基金行业从业经验。
金璜	本基金的基金经理	2024 年 2 月 6 日	-	8 年	工学硕士，CFA。曾任美国 AltfestPersonalWealthManagement（艾福斯特个人财富管理）投资部量化研究员，Morgan Stanley（美国摩根士丹利）风险管理部信用风险分析员。2018 年 7 月加入本公司，历任风险管理部经理、ETF 与创新投资部研究员、ETF 与创新投资部基金经理助理，自 2023 年 9 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 8 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

## 4.3 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、《景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 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。

### 4.4.2 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。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年受海外宏观流动性宽松预期及盈利改善预期巩固的提振，美股市场普遍走强，三大股指的表现分别为纳斯达克 100 (16.98%) > 标普 500 (14.48%) > 道琼斯工业指数 (3.79%)。

在最近一次的美联储议息会议上，美联储表示通胀已经实质性地放缓。美国 5 月 CPI 同比增长 3.3%，低于预期和前值 3.4%，为近两年来的最低水平；5 月 CPI 环比持平，为 2022 年 7 月以来最低水平。5 月核心 CPI 同比增长 3.4%，低于预期 3.5% 及前值 3.6%，为三年多以来的最低水平；核心 CPI 环比增长 0.2%，预期为持平于 0.3%。数据公布后，市场完全消化了美联储今年降息两次的预期，9 月降息的概率增至七成，11 月降息的可能性达到 100%。

### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年 1 月 24 日（基金合同生效日）至本报告期末，本基金份额净值增长率为 6.83%，业绩比较基准收益率为 6.18%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于长期表现稳定的美股消费板块，利率下行有望进一步提高板块的安全边际。美股消费板块各细分行业的龙头地位多由国际知名企业占据，在现金流、分红率、盈利能力等稳定性上较为优秀，在价格表现上美股消费板块长期表现出较低的波动率和较强的回撤控制能力。在中长期利率下行的背景下，叠加夏季出行及消费高峰的刺激，有望继续保持较为稳定的表现。同时，美股资产与中国资产较低的相关性，在组合风险分散上能够起到较为突出的作用，是全球配置中重要的一环。

本基金采用复制标的指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。在报告期内，本基金结合申购赎回情况、标的指数成分调整情况定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

#### 4.7 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。

相关定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 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：景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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
<b>资产：</b>		
货币资金	6.4.7.1	6,576,239.01
结算备付金		0.07
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	62,682,856.12
其中：股票投资		62,682,856.12
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		3,008.67
应收股利		74,050.80
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		69,336,154.67
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>
<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		2,017,709.47
应付赎回款		-
应付管理人报酬		27,011.20
应付托管费		10,804.52
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	2,611,628.75
负债合计		4,667,153.94
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.10	60,536,791.00
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	4,132,209.73
净资产合计		64,669,000.73
负债和净资产总计		69,336,154.67

注：1. 报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.0683 元，基金份额总额 60,536,791.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 24 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2024 年 1 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 24 日（基金合同 生效日）至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		11,832,394.21
1. 利息收入		47,527.37
其中：存款利息收入	6.4.7.13	47,527.37
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）		11,136,248.71
其中：股票投资收益	6.4.7.14	10,393,069.65
基金投资收益	6.4.7.15	-
债券投资收益	6.4.7.16	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-
股利收益	6.4.7.20	743,179.06
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）	6.4.7.21	3,954,927.75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		30,336.20
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	-3,336,645.82
<b>减：二、营业总支出</b>		529,768.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	269,078.54
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	107,631.47
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	6.4.7.23	-
7. 税金及附加		-

8. 其他费用	6. 4. 7. 24	153, 058. 10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11, 302, 626. 10
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11, 302, 626. 10
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		11, 302, 626. 10

### 6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2024 年 1 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 24 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	303, 536, 791. 00	-	-	303, 536, 791. 00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-243, 000, 000. 00	-	4, 132, 209. 73	-238, 867, 790. 27
（一）、综合收益总额	-	-	11, 302, 626. 10	11, 302, 626. 10
（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）	-243, 000, 000. 00	-	-7, 170, 416. 37	-250, 170, 416. 37
其中：1. 基金申购款	43, 000, 000. 00	-	1, 192, 849. 40	44, 192, 849. 40
2. 基金赎回款	-286, 000, 000. 00	-	-8, 363, 265. 77	-294, 363, 265. 77
（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	60,536,791.00	-	4,132,209.73	64,669,000.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(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[2023]1763号《关于准予景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的批复》注册,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《景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金,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303,519,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2024)第0005号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》于2024年1月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为303,536,791.00份基金份额,其中认购资金利息折合17,791.00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,境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2024]86号文审核同意,本基金303,536,791.00份基金份额于2024年2月2日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数标普500消费精选指数(英文名字:S&P 500 Consumer Select 15/60 Index),追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金主要投资于标的指数成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)。其余资产可投资于其他金融产品或工具。境外投资工具包括:已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF));已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支



持证券、资产支持证券以及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金为对冲外币的汇率风险，可以投资于境外外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。境内投资工具包括：本基金可少量投资于部分非成份股(包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、公开发行的次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及中国证监会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)。本基金可以根据有关法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。本基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为标普 500 消费精选指数收益率(使用估值汇率调整)。

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 1 月 24 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止期间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 24 日(基金合同生效日)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 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 24 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

## (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即

可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金收益评价日核定的基金净

值率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金的基金管理人可进行收益分配；以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则确定收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 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[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[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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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(如适用)起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。对基金通过沪港通或深港通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) 基金通过沪港通或深港通买卖、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	6,576,239.01
等于：本金	6,575,862.23

加：应计利息	376.78
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	6,576,239.01

注：于 2024 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：美元 202.73 元（折合人民币 1,444.82 元）。

#### 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	58,727,928.37	-	62,682,856.12	3,954,927.75
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	58,727,928.37	-	62,682,856.12	3,954,927.75

注：于 2024 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 0.00 元。

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-

其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	152,234.10
应退替代款	2,343,034.87
可退替代款	116,359.78
合计	2,611,628.75

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月24日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	303,536,791.00	303,536,791.00
本期申购	43,000,000.00	43,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-286,000,000.00	-286,000,000.00
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	60,536,791.00	60,536,791.00

注：本基金合同于2024年1月24日生效。首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币303,519,000.00元，折合303,519,000.00份基金份额，有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币18,575.37元，其中人民币17,791.00元折合17,791.00份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币303,536,791.00元，折合303,536,791.00份基金份额。

#### 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
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	7,347,698.35	3,954,927.75	11,302,626.10
本期基金份额交易产生的变动数	-2,664,463.38	-4,505,952.99	-7,170,416.37
其中：基金申购款	409,220.82	783,628.58	1,192,849.40

基金赎回款	-3,073,684.20	-5,289,581.57	-8,363,265.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,683,234.97	-551,025.24	4,132,209.73

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月24日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
活期存款利息收入		47,485.40
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		41.97
其他		-
合计		47,527.37

#### 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24日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		10,393,069.65
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		10,393,069.65

##### 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24日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		242,135,468.85
减：卖出股票成本总额		231,680,674.33
减：交易费用		61,724.87
买卖股票差价收入		10,393,069.65

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月24日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
赎回基金份额对价总额		294,363,265.77
减：现金支付赎回款总额		294,363,265.77
减：赎回股票成本总额		-
减：交易费用		-
赎回差价收入		-

## 6.4.7.14.4 股票投资收益——证券出借收入

无。

## 6.4.7.15 基金投资收益

无。

## 6.4.7.16 债券投资收益

## 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

## 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

## 6.4.7.18 贵金属投资收益

## 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.19 衍生工具收益

## 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	743,179.06
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	743,179.06

## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月24日（基金合同生效日）至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	3,954,927.75
股票投资	3,954,927.75
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,954,927.75

注：本基金本会计期间公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益0.00元。

## 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月24日（基金合同生效日）至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-3,336,645.82
合计	-3,336,645.82

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申赎本基金时，补入（卖出）被替代成分券的实际买入（卖出）成本与申赎确认日估值的差额，或强制退款的被替代成分券在强制退款计算日与申赎确认日估值的差额。

## 6.4.7.23 信用减值损失

无。

## 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月24日（基金合同生效日）至2024年6月30日
审计费用	23,177.43
信息披露费	55,626.15
证券出借违约金	-
银行划款手续费	424.00
其他	400.00

IOPV 数据费	8,196.00
注册登记费	65,234.52
合计	153,058.10

#### 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

##### 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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
香港上海汇丰银行有限公司（“汇丰银行”）	境外资产托管人
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
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

##### 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24日（基金合同生效日）至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	269,078.54
其中：应支付销售机构的客户维护	45,633.22

费	
应支付基金管理人的净管理费	223,445.32

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 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 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	107,631.47

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期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

本基金本报告期末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

本基金于本报告期末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

本基金于本报告期末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自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末运用自有资金投资本基金。

##### 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 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入
汇丰银行-活期	2,705,301.42	22,986.21
中国工商银行-活期	3,870,937.59	24,499.19

注：本基金的活期银行存款由基金托管人和境外资产托管人保管，并按银行间同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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

本基金本报告期无利润分配。

#### 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

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

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。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要

求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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	6,576,239.01	-	-	-	-	-	6,576,239.01
结算备付金	0.07	-	-	-	-	-	0.07
交易性金融资产	-	-	-	-	-	62,682,856.12	62,682,856.12
应收股利	-	-	-	-	-	74,050.80	74,050.80
应收清算款	-	-	-	-	-	3,008.67	3,008.67
资产总计	6,576,239.08	-	-	-	-	62,759,915.59	69,336,154.67
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	27,011.20	27,011.20
应付托管费	-	-	-	-	-	10,804.52	10,804.52
应付清算款	-	-	-	-	-	2,017,709.47	2,017,709.47
其他负债	-	-	-	-	-	2,611,628.75	2,611,628.75
负债总计	-	-	-	-	-	4,667,153.94	4,667,153.94
利率敏感度缺口	6,576,239.08	-	-	-	-	-	-

#### 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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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 2024年6月30日			合计
	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	
以外币计价的资产				

货币资金	1,444.82	-	-	1,444.82
交易性金融资产	62,682,856.12	-	-	62,682,856.12
应收股利	74,050.80	-	-	74,050.80
资产合计	62,758,351.74	-	-	62,758,351.74
以外币计价的负债				
应付清算款	2,017,709.47	-	-	2,017,709.47
负债合计	2,017,709.47	-	-	2,017,709.47
资产负债表外汇风险敞口净额	60,740,642.27	-	-	60,740,642.27

#### 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（2024年6月30日）
	所有外币相对人民币升值5%	3,037,032.11
	所有外币相对人民币贬值5%	-3,037,032.11

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	62,682,856.12	96.93
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	62,682,856.12	96.93

## 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）
	沪深 300 指数上升 5%	360,000.37
	沪深 300 指数下降 5%	-360,000.37

## 6.4.14 公允价值

## 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

## 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	62,682,856.12
第二层次	-
第三层次	-
合计	62,682,856.12

## 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	62,682,856.12	90.40
	其中：普通股	62,682,856.12	90.40
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,576,239.08	9.48
8	其他各项资产	77,059.47	0.11
9	合计	69,336,154.67	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	62,682,856.12	96.93
合计	62,682,856.12	96.93

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

## 7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
原材料	-	-
周期性消费品	32,591,930.48	50.40
非周期性消费品	18,630,323.90	28.81
综合	-	-

能源	-	-
金融	-	-
基金	-	-
工业	-	-
信息科技	-	-
公用事业	-	-
通讯	11,460,601.74	17.72
合计	62,682,856.12	96.93

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

#### 7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	6,505	8,959,037.92	13.85
2	TESLA INC	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达克证券交易所	美国	4,277	6,031,644.31	9.33
3	PROCTER & GAMBLE CO/THE	宝洁	PG UN	纽约证券交易所	美国	3,638	4,275,930.05	6.61
4	COSTCO WHOLESALE CORP	开市客	COST US	纳斯达克证券交易所	美国	683	4,137,415.06	6.40
5	HOME DEPOT INC	家得宝	HD UN	纽约证券交易所	美国	1,527	3,746,234.35	5.79
6	WALMART INC	沃尔玛股份有限公司	WMT UN	纽约证券交易所	美国	6,585	3,177,628.81	4.91
7	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO UN	纽约证券交易所	美国	5,977	2,711,291.64	4.19
8	PEPSICO INC	百事可乐	PEP US	纳斯达克证券交易所	美国	2,119	2,490,721.60	3.85
9	MCDONALD'S CORP	麦当劳	MCD UN	纽约证券交易所	美国	1,111	2,017,791.21	3.12

10	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	菲利普莫里斯国际集团公司	PM UN	纽约证券交易所	美国	2,396	1,730,292.11	2.68
11	BOOKING HOLDINGS INC	Booking 控股股份有限公司	BKNG US	纳斯达克证券交易所	美国	52	1,468,106.55	2.27
12	LOWE'S COS INC	劳氏	LOW UN	纽约证券交易所	美国	882	1,385,775.76	2.14
13	TJX COMPANIES INC	TJX 公司	TJX UN	纽约证券交易所	美国	1,745	1,369,232.89	2.12
14	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE UN	纽约证券交易所	美国	1,867	1,002,853.29	1.55
15	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,746	968,718.13	1.50
16	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	亿滋国际	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	2,067	964,002.90	1.49
17	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	Chipotle Mexican Grill 股份有	CMG UN	纽约证券交易所	美国	2,117	945,227.84	1.46
18	COLGATE-PALMOLIVE CO	高露洁棕榄	CL UN	纽约证券交易所	美国	1,264	874,163.03	1.35
19	ALTRIA GROUP INC	高特利	MO UN	纽约证券交易所	美国	2,647	859,284.33	1.33
20	TARGET CORP	塔吉特公司	TGT UN	纽约证券交易所	美国	713	752,251.70	1.16
21	AIRBNB INC-CLASS A	爱彼迎股份有限公司	ABNB US	纳斯达克证券交易所	美国	680	734,832.95	1.14
22	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY US	纳斯达克证券交易所	美国	90	677,369.56	1.05
23	MARRIOTT	万豪国际	MAR US	纳斯达克证券交易所	美国	369	635,804.13	0.98



	INTERNATIONAL-CL A			所				
24	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT UN	纽约证券交易所	美国	385	598,701.09	0.93
25	GENERAL MOTORS CO	通用汽车公司	GM UN	纽约证券交易所	美国	1,758	582,093.36	0.90
26	AUTOZONE INC	AutoZone 股份有限公司	AZO UN	纽约证券交易所	美国	26	549,238.24	0.85
27	FORD MOTOR CO	福特汽车	F UN	纽约证券交易所	美国	6,045	540,242.09	0.84
28	ROSS STORES INC	罗斯百货股份有限公司	ROST US	纳斯达克证券交易所	美国	516	534,403.95	0.83
29	KIMBERLY-CLARK CORP	金佰利	KMB UN	纽约证券交易所	美国	519	511,175.43	0.79
30	DR HORTON INC	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约证券交易所	美国	456	457,997.25	0.71
31	CONSTELLATION BRANDS INC-A	星座品牌股份有限公司	STZ UN	纽约证券交易所	美国	248	454,728.61	0.70
32	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	皇家加勒比国际游轮有限公司	RCL UN	纽约证券交易所	美国	364	413,586.16	0.64
33	YUM! BRANDS INC	百胜餐饮集团	YUM UN	纽约证券交易所	美国	434	409,702.91	0.63
34	LENNAR CORP-A	Lennar 公司	LEN UN	纽约证券交易所	美国	377	402,671.26	0.62
35	GENERAL MILLS INC	通用磨坊	GIS UN	纽约证券交易所	美国	870	392,231.99	0.61
36	SYSCO CORP	Sysco 公司	SYU UN	纽约证券交易所	美国	767	390,235.99	0.60

37	MONSTER BEVERAGE CORP	怪兽饮料公司	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	1,093	389,090.14	0.60
38	KEURIG DR PEPPER INC	Keurig Dr Pepper 有限公司	KDP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,609	382,998.51	0.59
39	KENVUE INC	Kenvue Inc	KVUE UN	纽约证券交易所	美国	2,951	382,346.98	0.59
40	LULULEMON ATHLETICA INC	Lululemon Athletica 股份有限公司	LULU US	纳斯达克证券交易所	美国	176	374,664.43	0.58
41	KROGER CO	克罗格公司	KR UN	纽约证券交易所	美国	1,031	366,872.20	0.57
42	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约证券交易所	美国	762	328,281.08	0.51
43	TRACTOR SUPPLY COMPANY	拖拉机供应公司	TSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	166	319,423.18	0.49
44	DOLLAR GENERAL CORP	达乐公司	DG UN	纽约证券交易所	美国	338	318,523.35	0.49
45	EBAY INC	eBay 公司	EBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	780	298,624.32	0.46
46	HERSHEY CO/THE	好时公司	HSY UN	纽约证券交易所	美国	227	297,397.16	0.46
47	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏公司	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	1,216	279,224.60	0.43
48	CHURCH & DWIGHT CO INC	切迟杜威股份有限公司	CHD UN	纽约证券交易所	美国	376	277,828.89	0.43
49	ESTEE LAUDER COMPANIES-CLASS A	雅诗兰黛	EL UN	纽约证券交易所	美国	359	272,226.66	0.42
50	DOLLAR TREE INC	美元树公司	DLTR US	纳斯达克证券交易所	美国	319	242,736.17	0.38

注：本基金对以上证券代码采用彭博代码即 BB Ticker。

#### 7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

#### 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

##### 7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	AMAZON.COM INC	AMZN US	42,764,321.43	66.13
2	TESLA INC	TSLA US	27,601,146.11	42.68
3	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG UN	18,978,808.06	29.35
4	HOME DEPOT INC	HD UN	18,550,535.84	28.69
5	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	16,092,758.89	24.88
6	WALMART INC	WMT UN	12,211,764.27	18.88
7	COCA-COLA CO/THE	KO UN	12,107,124.59	18.72
8	PEPSICO INC	PEP US	12,024,214.74	18.59
9	MCDONALD'S CORP	MCD UN	11,431,221.27	17.68
10	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PM UN	7,495,275.79	11.59
11	NIKE INC -CL B	NKE UN	6,495,499.99	10.04
12	LOWE'S COS INC	LOW UN	6,450,473.35	9.97
13	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	6,355,877.67	9.83
14	TJX COMPANIES INC	TJX UN	5,745,366.71	8.88
15	STARBUCKS CORP	SBUX US	5,515,798.38	8.53
16	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	MDLZ US	5,284,807.95	8.17
17	ALTRIA GROUP INC	MO UN	3,731,178.37	5.77
18	COLGATE-PALMOLIVE CO	CL UN	3,496,471.62	5.41
19	TARGET CORP	TGT UN	3,445,903.69	5.33
20	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	CMG UN	3,339,677.42	5.16
21	AIRBNB INC-CLASS A	ABNB US	3,307,118.26	5.11
22	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	ORLY US	3,165,951.74	4.90
23	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	MAR US	3,134,893.68	4.85
24	LULULEMON ATHLETICA INC	LULU US	2,844,994.15	4.40
25	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	HLT UN	2,544,305.33	3.93
26	ROSS STORES INC	ROST US	2,493,829.90	3.86
27	GENERAL MOTORS CO	GM UN	2,473,953.30	3.83
28	AUTOZONE INC	AZO UN	2,422,600.40	3.75
29	FORD MOTOR CO	F UN	2,319,511.21	3.59
30	DR HORTON INC	DHI UN	2,228,202.34	3.45
31	MONSTER BEVERAGE CORP	MNST US	2,157,043.34	3.34
32	CONSTELLATION BRANDS INC-A	STZ UN	2,113,734.08	3.27
33	KIMBERLY-CLARK CORP	KMB UN	2,102,678.65	3.25
34	SYSCO CORP	SYU UN	2,006,073.71	3.10

35	LENNAR CORP-A	LEN UN	1,940,046.84	3.00
36	GENERAL MILLS INC	GIS UN	1,938,878.14	3.00
37	KENVUE INC	KVUE UN	1,923,243.94	2.97
38	YUM! BRANDS INC	YUM UN	1,922,042.35	2.97
39	KEURIG DR PEPPER INC	KDP US	1,668,340.39	2.58
40	KROGER CO	KR UN	1,632,063.64	2.52
41	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	EL UN	1,565,886.80	2.42
42	KRAFT HEINZ CO/THE	KHC US	1,546,857.38	2.39
43	DOLLAR GENERAL CORP	DG UN	1,533,319.90	2.37
44	HERSHEY CO/THE	HSY UN	1,484,459.30	2.30
45	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	ADM UN	1,483,923.87	2.29
46	DOLLAR TREE INC	DLTR US	1,439,814.45	2.23

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。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	AMAZON.COM INC	AMZN US	39,324,636.39	60.81
2	TESLA INC	TSLA US	21,577,834.21	33.37
3	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG UN	15,794,680.27	24.42
4	HOME DEPOT INC	HD UN	15,133,568.69	23.40
5	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	13,763,143.78	21.28
6	WALMART INC	WMT UN	10,596,747.57	16.39
7	COCA-COLA CO/THE	KO UN	9,854,340.83	15.24
8	PEPSICO INC	PEP US	9,797,798.18	15.15
9	MCDONALD'S CORP	MCD UN	8,654,188.75	13.38
10	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PM UN	5,991,001.74	9.26
11	LOWE'S COS INC	LOW UN	5,515,419.93	8.53
12	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	5,245,360.58	8.11
13	NIKE INC -CL B	NKE UN	5,171,566.54	8.00
14	TJX COMPANIES INC	TJX UN	4,736,176.02	7.32
15	STARBUCKS CORP	SBUX US	4,372,698.59	6.76
16	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	MDLZ US	4,118,782.40	6.37
17	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	CMG UN	3,088,420.90	4.78
18	ALTRIA GROUP INC	MO UN	3,083,924.34	4.77
19	COLGATE-PALMOLIVE CO	CL UN	2,992,296.80	4.63
20	TARGET CORP	TGT UN	2,935,578.15	4.54
21	AIRBNB INC-CLASS A	ABNB US	2,754,527.42	4.26
22	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	ORLY US	2,579,329.29	3.99
23	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	MAR US	2,547,474.65	3.94
24	GENERAL MOTORS CO	GM UN	2,345,723.32	3.63
25	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	HLT UN	2,139,356.61	3.31
26	LULULEMON ATHLETICA INC	LULU US	2,075,388.77	3.21

27	ROSS STORES INC	ROST US	2,044,944.69	3.16
28	FORD MOTOR CO	F UN	2,028,359.38	3.14
29	AUTOZONE INC	AZO UN	1,997,636.31	3.09
30	DR HORTON INC	DHI UN	1,837,017.15	2.84
31	KIMBERLY-CLARK CORP	KMB UN	1,747,364.54	2.70
32	MONSTER BEVERAGE CORP	MNST US	1,736,538.59	2.69
33	CONSTELLATION BRANDS INC-A	STZ UN	1,672,179.79	2.59
34	SYSCO CORP	SYU UN	1,656,928.06	2.56
35	LENNAR CORP-A	LEN UN	1,617,535.89	2.50
36	YUM! BRANDS INC	YUM UN	1,579,293.27	2.44
37	GENERAL MILLS INC	GIS UN	1,578,116.60	2.44
38	KENVUE INC	KVUE UN	1,417,291.10	2.19
39	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	EL UN	1,380,857.73	2.14
40	KROGER CO	KR UN	1,354,474.40	2.09
41	KEURIG DR PEPPER INC	KDP US	1,304,074.79	2.02

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。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	290,408,602.70
卖出收入（成交）总额	242,135,468.85

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。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

### 7.11 投资组合报告附注

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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日

前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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	3,008.67
3	应收股利	74,050.80
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	77,059.47

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.11.6 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 (%)
1,798	33,668.96	18,749,105.00	30.97	41,787,686.00	69.03

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	北京天道众合投资管理有限公司一天道众合一号私募证券投资基金	5,394,944.00	8.91

2	北京天道众合投资管理有限公司一天道众合二号私募证券投资基金	3,749,722	6.19
3	江佳阳	2,664,302	4.40
4	陈帆	1,719,100	2.84
5	林蓝涛	1,647,200	2.72
6	西藏博恩资产管理有限公司一博恩添富7号私募证券投资基金	1,350,000	2.23
7	周仕国	1,058,300	1.75
8	广东长线富利私募基金管理有限公司一长线富利价值1号私募证券投资基金	1,020,000.00	1.68
9	兴业证券股份有限公司	1,000,000.00	1.65
10	绍兴忠兴印染有限公司	1,000,000.00	1.65
11	江木溪	1,000,000.00	1.65

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	126,600.00	0.209129

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

1. 本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
2. 本期末本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2024 年 1 月 24 日) 基金份额总额	303,536,791.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	43,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	286,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	60,536,791.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
Haitong International Securities Company Limited	1	277,853,575.98	52.17	34,388.75	57.87	-
China International Capital Corporation Limited	1	251,535,196.14	47.23	24,373.35	41.01	-
CLSA Limited	1	2,009,894.19	0.38	493.16	0.83	-
UBS Securities Asia Limited	1	1,145,405.24	0.22	171.56	0.29	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
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	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
高盛(中国)证券有限	1	-	-	-	-	-



责任公司						
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞信证券（中国）有限 公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公 司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中航证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中邮证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1. 基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

## 2) 选择程序

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

2. 本基金本报告期交易单元均为新增。

## 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

高盛（中国）证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞信证券（中国）有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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
2	关于景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月25日
3	景顺长城基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月26日
4	关于景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)关于开放日常申购和赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月30日
5	景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)上市交易公告书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月30日
6	景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)上市交易公告书	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月30日
7	关于景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)新增流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年2月2日
8	景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)上市交易提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年2月2日
9	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年2月6日
10	景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)2024年第1号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2024年2月7日
11	景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024年2月7日
12	关于景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)2024年境外主要市场节假日暂停申购及赎回业务安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年2月7日
13	关于景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金(QDII)新增国盛证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年2月28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3月22日

15	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
16	景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 境外主要市场节假日暂停申购及赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 28 日
17	关于景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 新增流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 9 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 13 日
19	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
20	景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 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
21	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
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增渤海证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 20 日
23	景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 境外主要市场节假日暂停申购及赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 24 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	2024 年 5 月 24 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	2024 年 5 月 31 日
26	景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 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
27	景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 境外主要市场节假日暂停申购及赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 17 日
28	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 18 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增联储证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 20 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增爱建证券为一级交易商	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 21 日

	的公告		
31	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
32	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

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	20240202-20240604	0.00	167,380,025.00	166,731,296.00	648,729.00	1.07

#### 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

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标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金（QDII）募集注册的文件；

2、《景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》；

3、《景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》；

4、《景顺长城标普消费精选交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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