

景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：招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。

基金托管人招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 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49

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	49
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	49
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	景顺长城量化平衡混合	
场内简称	无	
基金主代码	005258	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 27 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	50,836,895.83 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城量化平衡混合 A	景顺长城量化平衡混合 C
下属分级基金的交易代码	005258	019215
报告期末下属分级基金的份额总额	50,817,257.22 份	19,638.61 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型精选股票，在严格控制风险及考虑流动性的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金依据宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，形成资产配置方案。</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。</p> <p>3、固定收益类投资策略</p> <p>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，确定债券及现金管理工具资产配置。</p> <p>4、股指期货、国债期货投资策略</p> <p>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、中小企业私募债券投资策略</p>

	<p>在信用研究方面，本基金会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，尽可能对发行人进行充分详尽的调研和分析。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>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，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，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。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+一年期人民币定期存款利率(税后)×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高预期收益和风险水平的投资品种，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	张姗
	联系电话	0755-82370388	400-61-95555
	电子邮箱	investor@igwfm.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008888606	400-61-95555
传真		0755-22381339	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		李进	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	景顺长城量化平衡混合 A	景顺长城量化平衡混合 C
本期已实现收益	-3,061,030.79	-1,080.30
本期利润	-3,747,598.47	103.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0701	0.0044
本期加权平均净值利润率	-6.54%	0.41%
本期基金份额净值增长率	-6.20%	-6.45%
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	2,551,129.06	905.48
期末可供分配基金份额利润	0.0502	0.0461
期末基金资产净值	53,368,386.28	20,544.09
期末基金份额净值	1.0502	1.0461
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	5.02%	-9.94%

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

景顺长城量化平衡混合 A

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	-3.61%	0.74%	-2.50%	0.34%	-1.11%	0.40%
过去三个月	-3.23%	0.89%	-1.78%	0.50%	-1.45%	0.39%
过去六个月	-6.20%	1.25%	-0.62%	0.62%	-5.58%	0.63%
过去一年	-16.85%	1.05%	-6.57%	0.56%	-10.28%	0.49%
过去三年	-34.61%	1.03%	-18.74%	0.62%	-15.87%	0.41%
自基金合同生效起至今	5.02%	1.03%	-3.87%	0.72%	8.89%	0.31%

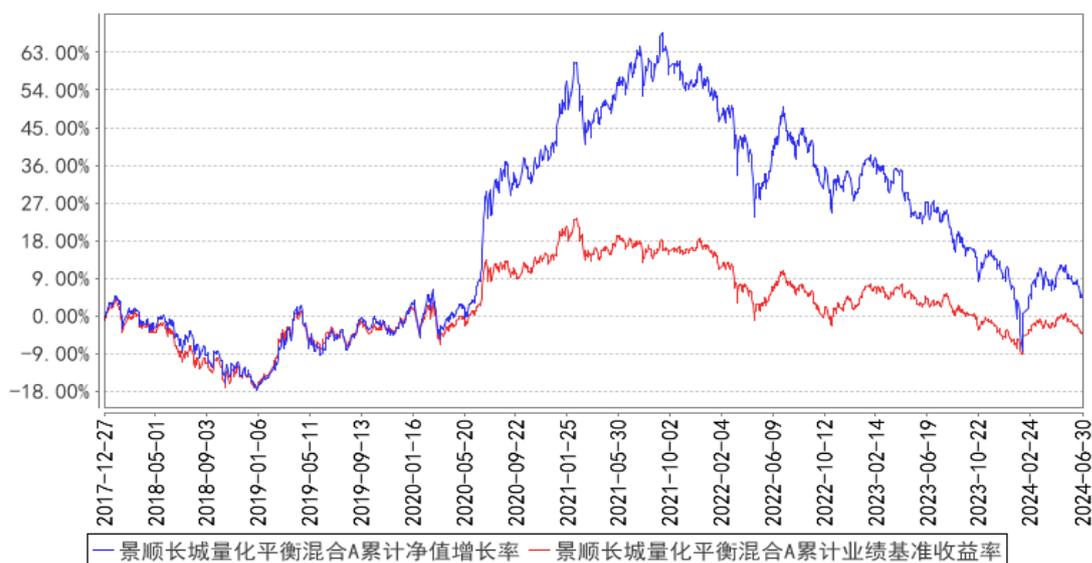
景顺长城量化平衡混合 C

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	-3.65%	0.74%	-2.50%	0.34%	-1.15%	0.40%
过去三个月	-3.36%	0.89%	-1.78%	0.50%	-1.58%	0.39%
过去六个月	-6.45%	1.25%	-0.62%	0.62%	-5.83%	0.63%
自基金合同生效起至今	-9.94%	1.09%	-4.81%	0.56%	-5.13%	0.53%

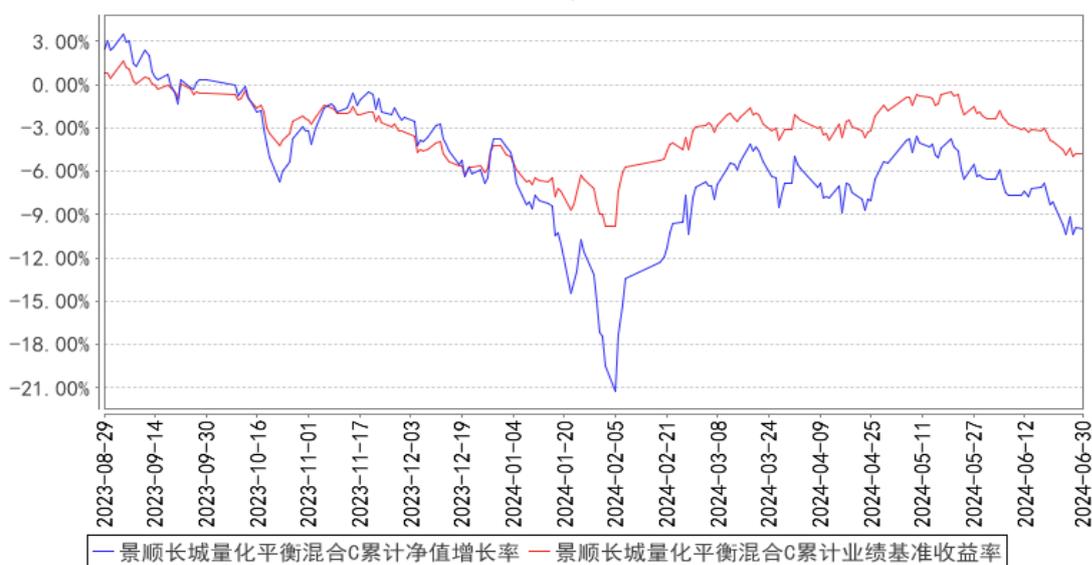
注：本基金自 2023 年 8 月 28 日起增设 C 类基金份额，并于 2023 年 8 月 29 日开始对 C 类基金份额进行估值。

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

景顺长城量化平衡混合A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



景顺长城量化平衡混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为0%–95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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2017年12月27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。本基金自2023年8月28日起增设C类基金份额。

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		
徐喻军	本基金的基金经理	2017年12月27日	-	14年	理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012年3月加入本公司，担任量化及ETF投资部ETF专员，自2014年4月起担任量化及指数投资部基金经理。具有14年证券、基金行业从业经验。
黎海威	本基金的基金经理	2017年12月27日	-	21年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪KMV公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，自2013年10月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有21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、《景顺长城量化平衡灵活配置混合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 9 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，国内经济在经历了一季度的亮眼开局之后出现一定的边际走弱，较强的出口数据带动工业生产保持韧性，内需在地产持续下行、居民预期偏弱的背景下仍旧疲弱。从数据来看，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 50.4、49.5、49.5，5、6 两月 PMI 重新跌入收缩区间。今年前 6 个月工业增加值累计同比增长 6.0%，其中 6 月份工业增加值当月同比增长 5.3%，经济延续弱复苏的格局。6 月 CPI 同比上升 0.2%，环比下降 0.2%；PPI 同比下降 0.8%，环比下降 0.2%，价格类指标依旧偏弱。6 月 M2 同比增长 6.2%，M1 同比下降 5.0%，信贷需求仍然偏弱；6 月末外汇储备

3.22 万亿美元，汇率短期承压。整体而言，国内经济依然处于弱复苏的态势，“稳增长”政策的效果正在逐步显现。上半年 A 股市场震荡调整，结构有所分化，上证指数下跌 0.25%，沪深 300 指数上涨 0.89%，创业板指数下跌 10.99%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年上半年，景顺长城量化平衡混合 A 类份额净值增长率为-6.20%，业绩比较基准收益率为-0.62%。

2024 年上半年，景顺长城量化平衡混合 C 类份额净值增长率为-6.45%，业绩比较基准收益率为-0.62%。

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 2024 年下半年，海外方面，美联储的货币政策依然是市场关注的热点，但其对国内资本市场的边际影响明显降低。国内方面，我们认为三季度国内经济环比二季度大概率能够边际回升，前期政策的累积效应以及新的“稳增长”政策对经济形成一定支撑；新“国九条”的推出将会改善股市微观供需结构，并进一步提升 A 股市场的投资价值。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。组合仍主要以选股作为主要的收益来源，在价值和成长之间保持平衡，重点关注估值合理、业绩表现稳健的价值蓝筹以及白马成长股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性、适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估

值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	3,281,460.21	3,910,930.05
结算备付金		1,282,110.77	1,350,437.48
存出保证金		5,895.20	6,911.56
交易性金融资产	6.4.7.2	49,169,515.80	57,844,901.49
其中：股票投资		49,169,515.80	57,838,901.04
基金投资		-	-
债券投资		-	6,000.45
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		-	-
应收申购款		1,311.87	2,194.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		53,740,293.85	63,115,375.07
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,038.21	149,858.19
应付管理人报酬		54,060.88	63,830.77
应付托管费		9,010.15	10,638.46
应付销售服务费		10.34	12.13
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	287,243.90	294,825.56
负债合计		351,363.48	519,165.11
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	50,836,895.83	55,908,774.63
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,552,034.54	6,687,435.33
净资产合计		53,388,930.37	62,596,209.96
负债和净资产总计		53,740,293.85	63,115,375.07

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 50,836,895.83 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.0502 元，基金份额 50,817,257.22 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.0461 元，基金份额 19,638.61 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-3,251,490.91	-1,379,345.53
1. 利息收入		16,941.68	28,881.87
其中：存款利息收入	6.4.7.13	16,941.68	28,881.87
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）		-2,585,759.93	-4,745,579.60
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,243,773.93	-5,602,423.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,422.50	27,533.34
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	656,591.50	829,310.81
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	-685,383.78	3,284,963.72
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	2,711.12	52,388.48
减：二、营业总支出		496,003.96	1,027,431.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	341,533.65	790,075.77
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	56,922.25	131,679.36
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	77.27	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.03
8. 其他费用	6.4.7.23	97,470.79	105,676.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,747,494.87	-2,406,777.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,747,494.87	-2,406,777.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,747,494.87	-2,406,777.37

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	55,908,774.63	-	6,687,435.33	62,596,209.96
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	55,908,774.63	-	6,687,435.33	62,596,209.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,071,878.80	-	-4,135,400.79	-9,207,279.59
(一)、综合收益总额	-	-	-3,747,494.87	-3,747,494.87
(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)	-5,071,878.80	-	-387,905.92	-5,459,784.72
其中：1. 基金申购款	541,370.04	-	36,503.26	577,873.30
2. 基金赎回款	-5,613,248.84	-	-424,409.18	-6,037,658.02
(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	50,836,895.83	-	2,552,034.54	53,388,930.37
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	88,610,818.19	-	26,121,720.80	114,732,538.99
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	88,610,818.19	-	26,121,720.80	114,732,538.99
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-26,702,953.44	-	-9,841,610.40	-36,544,563.84
(一)、综合收益总额	-	-	-2,406,777.37	-2,406,777.37

(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)	-26,702,953.44	-	-7,434,833.03	-34,137,786.47
其中：1. 基金申购款	1,240,427.99	-	405,497.10	1,645,925.09
2. 基金赎回款	-27,943,381.43	-	-7,840,330.13	-35,783,711.56
(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	61,907,864.75	-	16,280,110.40	78,187,975.15

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

景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2017]1790 号文《关于准予景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，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《景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2017 年 12 月 27 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,252,010,880.63 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 613,522.59 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,252,624,403.22 元，折合 1,252,624,403.22 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，登记机构为本基金管理人，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据法律法规的规定及《景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的约定，经与基金托管人招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 8 月 28 日起对景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费；C 类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、债券（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、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、债券回购等）、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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 0%–95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×60%+一年期人民币定期存款利率（税后）×40%。

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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行

和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	3,281,460.21
等于：本金	3,281,147.18
加：应计利息	313.03
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	3,281,460.21

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	50,835,045.80	-	49,169,515.80	-1,665,530.00
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	50,835,045.80	-	49,169,515.80	-1,665,530.00

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

本基金本报告期末的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

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末的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

本基金本报告期末的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

本基金本报告期末的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

本基金本报告期末的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 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	200,866.90
其中：交易所市场	200,866.90
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,377.00
合计	287,243.90

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城量化平衡混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,888,742.26	55,888,742.26
本期申购	472,375.83	472,375.83
本期赎回（以“-”号填列）	-5,543,860.87	-5,543,860.87
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	50,817,257.22	50,817,257.22

景顺长城量化平衡混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,032.37	20,032.37
本期申购	68,994.21	68,994.21
本期赎回（以“-”号填列）	-69,387.97	-69,387.97
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	19,638.61	19,638.61

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

景顺长城量化平衡混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,236,749.21	-11,551,680.82	6,685,068.39
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	18,236,749.21	-11,551,680.82	6,685,068.39
本期利润	-3,061,030.79	-686,567.68	-3,747,598.47
本期基金份额交易产生的变动数	-1,362,253.40	975,912.54	-386,340.86
其中：基金申购款	121,657.96	-89,878.02	31,779.94
基金赎回款	-1,483,911.36	1,065,790.56	-418,120.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,813,465.02	-11,262,335.96	2,551,129.06

景顺长城量化平衡混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,508.40	-4,141.46	2,366.94
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	6,508.40	-4,141.46	2,366.94
本期利润	-1,080.30	1,183.90	103.60
本期基金份额交易产生的变动数	-171.17	-1,393.89	-1,565.06
其中：基金申购款	16,759.80	-12,036.48	4,723.32
基金赎回款	-16,930.97	10,642.59	-6,288.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,256.93	-4,351.45	905.48

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	6,531.81
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	10,364.09
其他	45.78
合计	16,941.68

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,243,773.93
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	-3,243,773.93

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	215,830,197.40
减：卖出股票成本总额	218,537,831.32
减：交易费用	536,140.01
买卖股票差价收入	-3,243,773.93

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,422.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,422.50

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,423.25
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,000.00
减：应计利息总额	0.95
减：交易费用	0.30
买卖债券差价收入	1,422.00

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	656,591.50
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	656,591.50

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	-685,383.78
股票投资	-685,383.78
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	-685,383.78

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	1,218.20
基金转换费收入	1,492.92
合计	2,711.12

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	17,404.66
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	18,900.00
银行划款手续费	1,493.79
合计	97,470.79

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有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1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	341,533.65	790,075.77
其中：应支付销售机构的客户维护费	157,243.38	315,339.08
应支付基金管理人的净管理费	184,290.27	474,736.69

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：

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

根据《景顺长城基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 22 日起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	56,922.25	131,679.36

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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

根据《景顺长城基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 22 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

(1) 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.60%/当年天数。

(2) 自 2023 年 8 月 28 日起，本基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原有基金份额转为 A 类基金份额。

(3) 本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期	3,281,460.21	6,531.81	6,325,166.33	14,741.76

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

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**

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

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。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券（上年度末：0.01%）。

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	3,281,460.21	-	-	-	-	-	3,281,460.21
结算备付金	1,282,110.77	-	-	-	-	-	1,282,110.77
存出保证金	5,895.20	-	-	-	-	-	5,895.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	49,169,515.80	49,169,515.80
应收申购款	-	-	-	-	-	1,311.87	1,311.87
资产总计	4,569,466.18	-	-	-	-	49,170,827.67	53,740,293.85
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,038.21	1,038.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	54,060.88	54,060.88
应付托管费	-	-	-	-	-	9,010.15	9,010.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10.34	10.34
其他负债	-	-	-	-	-	287,243.90	287,243.90
负债总计	-	-	-	-	-	351,363.48	351,363.48
利率敏感度缺口	4,569,466.18	-	-	-	-	-	-
上年度末 2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	3,910,930.05	-	-	-	-	-	3,910,930.05
结算备付金	1,350,437.48	-	-	-	-	-	1,350,437.48
存出保证金	6,911.56	-	-	-	-	-	6,911.56
交易性金融资产	-	-	-	-	6,000.45	57,838,901.04	57,844,901.49
应收申购款	-	-	-	-	-	2,194.49	2,194.49
资产总计	5,268,279.09	-	-	-	6,000.45	57,841,095.53	63,115,375.07
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	149,858.19	149,858.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	63,830.77	63,830.77
应付托管费	-	-	-	-	10,638.46	10,638.46
应付销售服务费	-	-	-	-	12.13	12.13
其他负债	-	-	-	-	294,825.56	294,825.56
负债总计	-	-	-	-	519,165.11	519,165.11
利率敏感度缺口	5,268,279.09	-	-	-6,000.45	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.00%（上年度末：0.01%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	49,169,515.80	92.10	57,838,901.04	92.40
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	49,169,515.80	92.10	57,838,901.04	92.40

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	3,094,957.67	2,792,100.44
	沪深 300 指数下降 5%	-3,094,957.67	-2,792,100.44

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	49,169,515.80	57,838,901.04
第二层次	-	6,000.45
第三层次	-	-
合计	49,169,515.80	57,844,901.49

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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

第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	49,169,515.80	91.49
	其中：股票	49,169,515.80	91.49
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	4,563,570.98	8.49
8	其他各项资产	7,207.07	0.01
9	合计	53,740,293.85	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	397,690.00	0.74
B	采矿业	3,221,068.00	6.03
C	制造业	33,568,698.65	62.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,698,384.00	5.05
E	建筑业	302,902.00	0.57

F	批发和零售业	1,059,506.00	1.98
G	交通运输、仓储和邮政业	1,242,713.00	2.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,230,877.40	6.05
J	金融业	1,936,688.75	3.63
K	房地产业	400,330.00	0.75
L	租赁和商务服务业	125,699.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	96,330.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	29,260.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	220,734.00	0.41
R	文化、体育和娱乐业	638,635.00	1.20
S	综合	-	-
	合计	49,169,515.80	92.10

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	700	1,027,173.00	1.92
2	300760	迈瑞医疗	2,900	843,639.00	1.58
3	600276	恒瑞医药	16,700	642,282.00	1.20
4	300750	宁德时代	3,220	579,696.60	1.09
5	600900	长江电力	18,300	529,236.00	0.99
6	300308	中际旭创	3,620	499,125.60	0.93
7	603501	韦尔股份	5,000	496,850.00	0.93
8	000975	银泰黄金	29,800	485,442.00	0.91
9	688008	澜起科技	8,000	457,280.00	0.86
10	300122	智飞生物	15,600	437,268.00	0.82
11	000651	格力电器	11,100	435,342.00	0.82
12	600941	中国移动	3,900	419,250.00	0.79
13	603160	汇顶科技	6,000	412,500.00	0.77
14	002422	科伦药业	13,400	406,422.00	0.76
15	300679	电连技术	9,500	382,185.00	0.72
16	601899	紫金矿业	21,300	374,241.00	0.70
17	600066	宇通客车	14,500	374,100.00	0.70
18	300394	天孚通信	4,019	355,359.98	0.67
19	601633	长城汽车	14,000	354,200.00	0.66
20	002371	北方华创	1,100	351,879.00	0.66

21	603727	博迈科	24,400	321,104.00	0.60
22	600183	生益科技	15,100	318,006.00	0.60
23	600585	海螺水泥	13,200	311,388.00	0.58
24	688012	中微公司	2,200	310,772.00	0.58
25	300783	三只松鼠	14,200	310,554.00	0.58
26	002352	顺丰控股	8,600	306,934.00	0.57
27	688578	艾力斯	4,800	305,952.00	0.57
28	600150	中国船舶	7,400	301,254.00	0.56
29	002594	比亚迪	1,200	300,300.00	0.56
30	002192	融捷股份	9,800	294,196.00	0.55
31	002179	中航光电	7,700	292,985.00	0.55
32	002001	新和成	15,100	289,920.00	0.54
33	000338	潍柴动力	17,700	287,448.00	0.54
34	000568	泸州老窖	2,000	286,980.00	0.54
35	688036	传音控股	3,640	278,605.60	0.52
36	000725	京东方 A	67,000	274,030.00	0.51
37	300498	温氏股份	13,800	273,516.00	0.51
38	600887	伊利股份	10,300	266,152.00	0.50
39	300408	三环集团	9,100	265,629.00	0.50
40	300832	新产业	3,900	263,016.00	0.49
41	605090	九丰能源	9,000	261,000.00	0.49
42	002466	天齐锂业	8,700	260,217.00	0.49
43	601601	中国太保	9,300	259,098.00	0.49
44	600674	川投能源	13,800	258,750.00	0.48
45	002138	顺络电子	9,300	255,378.00	0.48
46	600161	天坛生物	10,380	253,272.00	0.47
47	601336	新华保险	8,400	252,252.00	0.47
48	688076	诺泰生物	3,200	250,496.00	0.47
49	600893	航发动力	6,800	248,540.00	0.47
50	002252	上海莱士	31,500	246,330.00	0.46
51	601231	环旭电子	15,200	243,960.00	0.46
52	600050	中国联通	51,200	240,640.00	0.45
53	601077	渝农商行	47,500	238,450.00	0.45
54	300896	爱美客	1,380	237,498.00	0.44
55	601127	赛力斯	2,600	236,912.00	0.44
56	000550	江铃汽车	10,900	236,639.00	0.44
57	600737	中粮糖业	24,600	235,914.00	0.44
58	002128	电投能源	11,100	234,210.00	0.44
59	300002	神州泰岳	28,800	233,856.00	0.44
60	600845	宝信软件	7,300	233,089.00	0.44
61	600348	华阳股份	23,400	233,064.00	0.44
62	600039	四川路桥	29,400	231,966.00	0.43
63	002332	仙琚制药	20,300	231,623.00	0.43

64	002106	莱宝高科	21,100	229,990.00	0.43
65	600559	老白干酒	12,500	227,250.00	0.43
66	600329	达仁堂	6,900	223,491.00	0.42
67	601318	中国平安	5,400	223,344.00	0.42
68	601877	正泰电器	11,700	223,002.00	0.42
69	600803	新奥股份	10,700	222,560.00	0.42
70	688188	柏楚电子	1,200	221,460.00	0.41
71	601058	赛轮轮胎	15,600	218,400.00	0.41
72	600933	爱柯迪	14,700	217,413.00	0.41
73	300751	迈为股份	1,800	215,064.00	0.40
74	601019	山东出版	18,100	213,942.00	0.40
75	300433	蓝思科技	11,700	213,525.00	0.40
76	300502	新易盛	2,000	211,100.00	0.40
77	300130	新国都	12,600	209,664.00	0.39
78	600177	雅戈尔	29,400	209,328.00	0.39
79	002557	洽洽食品	7,400	208,606.00	0.39
80	000883	湖北能源	34,500	207,345.00	0.39
81	600096	云天化	10,600	205,852.00	0.39
82	600760	中航沈飞	5,100	204,510.00	0.38
83	600011	华能国际	21,200	203,944.00	0.38
84	000630	铜陵有色	56,100	202,521.00	0.38
85	600115	中国东航	50,400	202,104.00	0.38
86	000063	中兴通讯	7,200	201,384.00	0.38
87	301004	嘉益股份	2,200	200,200.00	0.37
88	000333	美的集团	3,100	199,950.00	0.37
89	688981	中芯国际	4,300	198,230.00	0.37
90	002544	普天科技	10,500	196,245.00	0.37
91	600642	申能股份	21,700	191,611.00	0.36
92	600377	宁沪高速	15,200	191,520.00	0.36
93	002180	纳思达	7,200	190,224.00	0.36
94	002463	沪电股份	5,200	189,800.00	0.36
95	600406	国电南瑞	7,600	189,696.00	0.36
96	600025	华能水电	17,300	186,494.00	0.35
97	300144	宋城演艺	23,100	185,493.00	0.35
98	601717	郑煤机	12,500	185,000.00	0.35
99	002833	弘亚数控	10,100	184,224.00	0.35
100	000690	宝新能源	35,800	182,580.00	0.34
101	300181	佐力药业	11,900	179,928.00	0.34
102	603882	金城医学	6,600	179,454.00	0.34
103	600985	淮北矿业	10,700	179,118.00	0.34
104	300623	捷捷微电	10,300	178,190.00	0.33
105	002475	立讯精密	4,500	176,895.00	0.33
106	601688	华泰证券	14,100	174,699.00	0.33

107	600489	中金黄金	11,800	174,640.00	0.33
108	600566	济川药业	5,500	174,405.00	0.33
109	601628	中国人寿	5,600	173,880.00	0.33
110	300251	光线传媒	20,600	173,246.00	0.32
111	300769	德方纳米	6,100	172,020.00	0.32
112	603112	华翔股份	16,300	171,313.00	0.32
113	688120	华海清科	900	170,622.00	0.32
114	002053	云南能投	14,100	170,469.00	0.32
115	300633	开立医疗	4,300	170,194.00	0.32
116	301301	川宁生物	13,300	169,974.00	0.32
117	002351	漫步者	12,900	169,635.00	0.32
118	600285	羚锐制药	7,000	169,470.00	0.32
119	002727	一心堂	10,800	162,972.00	0.31
120	600309	万华化学	2,000	161,720.00	0.30
121	000503	国新健康	24,100	160,747.00	0.30
122	603878	武进不锈	24,500	160,230.00	0.30
123	300857	协创数据	2,800	159,600.00	0.30
124	002984	森麒麟	6,600	158,994.00	0.30
125	000408	藏格矿业	6,600	158,862.00	0.30
126	300673	佩蒂股份	12,100	158,752.00	0.30
127	300979	华利集团	2,600	158,210.00	0.30
128	002237	恒邦股份	13,600	156,536.00	0.29
128	688408	中信博	1,700	156,536.00	0.29
129	000600	建投能源	24,800	156,240.00	0.29
130	601898	中煤能源	12,500	156,000.00	0.29
131	600916	中国黄金	16,200	155,844.00	0.29
132	603368	柳药集团	8,900	155,750.00	0.29
133	002158	汉钟精机	9,300	155,496.00	0.29
134	300547	川环科技	9,500	155,325.00	0.29
135	601975	招商南油	43,100	154,729.00	0.29
136	603239	浙江仙通	11,200	153,552.00	0.29
137	601615	明阳智能	16,200	152,928.00	0.29
138	300724	捷佳伟创	2,800	151,228.00	0.28
139	605305	中际联合	5,857	151,052.03	0.28
140	600398	海澜之家	16,300	150,612.00	0.28
141	002635	安洁科技	9,600	148,224.00	0.28
142	000612	焦作万方	22,800	148,200.00	0.28
143	603393	新天然气	4,100	142,434.00	0.27
144	300638	广和通	8,300	141,930.00	0.27
145	002276	万马股份	19,700	141,249.00	0.26
146	603733	仙鹤股份	8,000	140,640.00	0.26
147	603505	金石资源	5,000	139,650.00	0.26
148	603380	易德龙	6,900	138,552.00	0.26

149	605286	同力日升	5,600	136,248.00	0.26
150	600690	海尔智家	4,800	136,224.00	0.26
151	002558	巨人网络	14,300	134,992.00	0.25
152	600663	陆家嘴	15,300	134,946.00	0.25
153	002997	瑞鹄模具	4,200	134,274.00	0.25
154	001269	欧晶科技	4,800	133,440.00	0.25
155	002540	亚太科技	25,100	132,779.00	0.25
156	300973	立高食品	4,700	132,023.00	0.25
157	002223	鱼跃医疗	3,500	131,600.00	0.25
158	601865	福莱特	6,500	130,650.00	0.24
159	605555	德昌股份	6,900	128,409.00	0.24
160	300124	汇川技术	2,500	128,250.00	0.24
161	002088	鲁阳节能	10,600	128,154.00	0.24
162	603185	弘元绿能	7,300	124,757.00	0.23
163	300379	东方通	15,400	124,432.00	0.23
164	300842	帝科股份	3,200	124,160.00	0.23
165	002410	广联达	12,880	123,390.40	0.23
166	603605	珀莱雅	1,100	122,089.00	0.23
167	603606	东方电缆	2,500	122,025.00	0.23
168	603008	喜临门	6,900	119,577.00	0.22
169	600522	中天科技	7,400	117,290.00	0.22
170	003000	劲仔食品	9,700	116,885.00	0.22
171	300494	盛天网络	11,400	114,570.00	0.21
172	002563	森马服饰	19,400	112,714.00	0.21
173	300366	创意信息	15,400	111,496.00	0.21
174	605020	永和股份	5,800	111,244.00	0.21
175	601225	陕西煤业	4,300	110,811.00	0.21
176	003029	吉大正元	6,200	110,298.00	0.21
177	002803	吉宏股份	9,900	110,187.00	0.21
178	688123	聚辰股份	1,800	109,494.00	0.21
179	605499	东鹏饮料	500	107,875.00	0.20
180	600989	宝丰能源	6,200	107,446.00	0.20
181	300003	乐普医疗	7,200	106,848.00	0.20
182	002353	杰瑞股份	2,900	101,732.00	0.19
183	000567	海德股份	17,975	100,839.75	0.19
184	600529	山东药玻	3,800	96,292.00	0.18
185	603330	天洋新材	20,000	95,800.00	0.18
186	000712	锦龙股份	12,700	95,250.00	0.18
187	300894	火星人	7,400	94,868.00	0.18
188	002683	广东宏大	4,700	94,611.00	0.18
189	001979	招商蛇口	10,700	94,053.00	0.18
190	000768	中航西飞	3,900	93,717.00	0.18
191	002008	大族激光	4,500	93,600.00	0.18

192	603132	金徽股份	6,700	92,192.00	0.17
193	002714	牧原股份	2,100	91,560.00	0.17
194	600580	卧龙电驱	7,500	91,125.00	0.17
195	600660	福耀玻璃	1,900	91,010.00	0.17
196	603719	良品铺子	7,700	89,859.00	0.17
197	600548	深高速	8,400	89,292.00	0.17
198	600938	中国海油	2,700	89,100.00	0.17
199	002215	诺普信	11,900	88,655.00	0.17
200	002019	亿帆医药	6,900	85,284.00	0.16
201	600295	鄂尔多斯	8,500	84,320.00	0.16
202	300659	中孚信息	6,500	84,305.00	0.16
203	002840	华统股份	5,000	82,950.00	0.16
204	000030	富奥股份	16,400	80,524.00	0.15
205	600007	中国国贸	3,600	79,056.00	0.15
206	300662	科锐国际	4,900	79,037.00	0.15
207	688016	心脉医疗	800	78,440.00	0.15
208	600188	兖矿能源	3,400	77,282.00	0.14
209	002415	海康威视	2,500	77,275.00	0.14
210	603826	坤彩科技	2,660	77,060.20	0.14
211	601328	交通银行	10,000	74,700.00	0.14
212	601021	春秋航空	1,300	73,229.00	0.14
213	002185	华天科技	8,900	72,535.00	0.14
214	000758	中色股份	14,200	72,136.00	0.14
215	688233	神工股份	3,700	71,299.00	0.13
216	603806	福斯特	4,680	68,796.00	0.13
217	601006	大秦铁路	9,600	68,736.00	0.13
218	601009	南京银行	6,600	68,574.00	0.13
219	688598	金博股份	2,400	67,920.00	0.13
220	600030	中信证券	3,700	67,451.00	0.13
221	000887	中鼎股份	5,400	66,096.00	0.12
222	600223	福瑞达	9,300	65,751.00	0.12
223	000913	钱江摩托	4,100	64,616.00	0.12
224	600640	国脉文化	6,200	64,170.00	0.12
225	603688	石英股份	2,100	62,181.00	0.12
226	600886	国投电力	3,400	62,016.00	0.12
227	603203	快克智能	2,600	61,308.00	0.11
228	603983	丸美股份	2,200	60,566.00	0.11
229	300037	新宙邦	2,100	59,976.00	0.11
230	002241	歌尔股份	3,000	58,530.00	0.11
231	601939	建设银行	7,900	58,460.00	0.11
232	300133	华策影视	9,500	58,330.00	0.11
233	000878	云南铜业	4,600	57,316.00	0.11
234	002879	长缆科技	4,300	56,459.00	0.11

235	002738	中矿资源	2,100	56,280.00	0.11
236	000960	锡业股份	3,600	55,764.00	0.10
237	300123	亚光科技	11,900	55,216.00	0.10
238	601166	兴业银行	3,100	54,622.00	0.10
239	601369	陕鼓动力	6,700	53,734.00	0.10
240	002756	永兴材料	1,500	53,670.00	0.10
241	300911	亿田智能	2,100	53,424.00	0.10
242	300113	顺网科技	5,200	53,248.00	0.10
243	000157	中联重科	6,900	52,992.00	0.10
244	000517	荣安地产	19,700	52,796.00	0.10
245	605016	百龙创园	2,550	51,943.50	0.10
246	601916	浙商银行	18,800	51,888.00	0.10
247	603032	德新科技	4,500	51,435.00	0.10
248	603960	克来机电	2,400	50,640.00	0.09
249	002048	宁波华翔	3,900	50,466.00	0.09
250	002195	岩山科技	20,100	50,451.00	0.09
251	603982	泉峰汽车	6,300	50,400.00	0.09
252	300085	银之杰	6,200	50,096.00	0.09
253	002865	钧达股份	1,300	49,894.00	0.09
254	300403	汉宇集团	7,200	49,176.00	0.09
255	605111	新洁能	1,600	48,944.00	0.09
256	300369	绿盟科技	9,500	48,545.00	0.09
257	300384	三联虹普	3,700	48,544.00	0.09
258	603535	嘉诚国际	3,000	48,420.00	0.09
259	002240	盛新锂能	3,600	48,312.00	0.09
260	688601	力芯微	1,100	48,059.00	0.09
261	603610	麒盛科技	4,800	47,424.00	0.09
262	688399	硕世生物	700	47,334.00	0.09
263	688148	芳源股份	11,200	47,152.00	0.09
264	002027	分众传媒	7,700	46,662.00	0.09
265	000661	长春高新	500	45,885.00	0.09
266	688111	金山办公	200	45,500.00	0.09
267	600993	马应龙	1,700	45,339.00	0.08
268	601000	唐山港	9,500	44,650.00	0.08
269	688121	卓然股份	3,700	44,474.00	0.08
270	688475	萤石网络	1,300	44,343.00	0.08
271	600795	国电电力	7,300	43,727.00	0.08
272	000426	兴业银锡	3,100	42,098.00	0.08
273	002318	久立特材	1,800	41,994.00	0.08
274	300015	爱尔眼科	4,000	41,280.00	0.08
275	601117	中国化学	5,000	41,200.00	0.08
276	000915	华特达因	1,300	39,208.00	0.07
277	300782	卓胜微	500	38,870.00	0.07

278	603533	掌阅科技	2,000	37,340.00	0.07
279	605589	圣泉集团	1,800	36,522.00	0.07
280	002123	梦网科技	5,100	35,853.00	0.07
281	300872	天阳科技	2,700	35,775.00	0.07
282	002736	国信证券	4,100	35,629.00	0.07
283	300482	万孚生物	1,400	34,160.00	0.06
284	000100	TCL 科技	7,600	32,832.00	0.06
285	002790	瑞尔特	3,600	32,508.00	0.06
286	605183	确成股份	2,100	32,466.00	0.06
287	002928	华夏航空	5,100	32,334.00	0.06
288	600023	浙能电力	4,500	31,995.00	0.06
289	002768	国恩股份	1,700	31,790.00	0.06
290	300693	盛弘股份	1,500	31,410.00	0.06
291	000963	华东医药	1,100	30,591.00	0.06
292	002611	东方精工	5,800	30,450.00	0.06
293	601668	中国建筑	5,600	29,736.00	0.06
294	000786	北新建材	1,000	29,660.00	0.06
295	600323	瀚蓝环境	1,400	29,260.00	0.05
296	603518	锦泓集团	3,300	29,040.00	0.05
297	000921	海信家电	900	29,016.00	0.05
298	000895	双汇发展	1,200	28,524.00	0.05
299	603728	鸣志电器	700	28,161.00	0.05
300	600707	彩虹股份	4,000	27,240.00	0.05
301	300571	平治信息	1,300	27,222.00	0.05
302	300146	汤臣倍健	2,000	27,100.00	0.05
303	002416	爱施德	3,000	26,550.00	0.05
303	300253	卫宁健康	4,500	26,550.00	0.05
304	688033	天宜上佳	4,400	26,400.00	0.05
305	603337	杰克股份	1,000	26,320.00	0.05
306	600458	时代新材	2,600	26,260.00	0.05
307	600598	北大荒	2,100	26,229.00	0.05
308	001213	中铁特货	6,600	26,070.00	0.05
309	600623	华谊集团	4,500	26,010.00	0.05
310	002773	康弘药业	1,200	25,980.00	0.05
311	300390	天华新能	1,500	25,770.00	0.05
312	002078	太阳纸业	1,800	25,110.00	0.05
313	000423	东阿阿胶	400	25,040.00	0.05
314	601101	昊华能源	2,700	24,813.00	0.05
315	600848	上海临港	2,700	24,597.00	0.05
316	600362	江西铜业	1,000	23,680.00	0.04
317	603893	瑞芯微	400	23,668.00	0.04
318	603259	药明康德	600	23,514.00	0.04
319	600380	健康元	2,100	23,457.00	0.04

320	603198	迎驾贡酒	400	23,000.00	0.04
321	300017	网宿科技	2,900	22,910.00	0.04
322	605186	健麾信息	1,000	22,460.00	0.04
323	600584	长电科技	700	22,197.00	0.04
324	688167	炬光科技	400	22,000.00	0.04
325	600600	青岛啤酒	300	21,831.00	0.04
326	600809	山西汾酒	100	21,088.00	0.04
327	300833	浩洋股份	450	20,880.00	0.04
328	002465	海格通信	2,000	20,720.00	0.04
329	601636	旗滨集团	3,200	20,640.00	0.04
330	600299	安迪苏	2,100	20,370.00	0.04
331	601001	晋控煤业	1,200	19,824.00	0.04
332	002698	博实股份	1,600	19,632.00	0.04
333	603877	太平鸟	1,400	19,222.00	0.04
334	688031	星环科技	500	18,355.00	0.03
335	300274	阳光电源	280	17,368.40	0.03
336	601607	上海医药	900	17,199.00	0.03
337	300566	激智科技	1,200	16,788.00	0.03
338	002601	龙佰集团	900	16,713.00	0.03
339	002517	恺英网络	1,700	16,235.00	0.03
340	688025	杰普特	400	16,156.00	0.03
341	688372	伟测科技	400	15,732.00	0.03
342	688080	映翰通	500	15,165.00	0.03
343	000029	深深房 A	1,400	14,882.00	0.03
344	688176	亚虹医药	2,900	14,819.00	0.03
345	603730	岱美股份	1,420	14,114.80	0.03
346	300079	数码视讯	3,400	13,804.00	0.03
347	688095	福昕软件	300	13,743.00	0.03
348	001222	源飞宠物	1,100	13,475.00	0.03
349	601568	北元集团	3,600	13,356.00	0.03
350	002550	千红制药	2,400	12,936.00	0.02
351	002824	和胜股份	1,000	12,760.00	0.02
352	688516	奥特维	300	12,543.00	0.02
353	300993	玉马遮阳	1,400	12,516.00	0.02
354	605116	奥锐特	500	12,515.00	0.02
355	600201	生物股份	1,700	12,257.00	0.02
356	603297	永新光学	200	12,098.00	0.02
357	000727	冠捷科技	5,700	11,742.00	0.02
358	688088	虹软科技	400	11,544.00	0.02
359	688153	唯捷创芯	300	11,100.00	0.02
360	688776	国光电气	200	11,080.00	0.02
361	000403	派林生物	400	10,664.00	0.02
362	688289	圣湘生物	600	10,548.00	0.02

363	600452	涪陵电力	800	10,136.00	0.02
364	600019	宝钢股份	1,500	9,975.00	0.02
365	605007	五洲特纸	700	8,841.00	0.02
366	002536	飞龙股份	900	8,568.00	0.02
367	688621	阳光诺和	200	8,540.00	0.02
368	688177	百奥泰	400	8,448.00	0.02
369	002020	京新药业	800	8,376.00	0.02
370	002267	陕天然气	1,100	8,316.00	0.02
371	600426	华鲁恒升	300	7,992.00	0.01
372	605369	拱东医疗	200	7,980.00	0.01
373	601528	瑞丰银行	1,600	7,552.00	0.01
374	605339	南侨食品	500	7,110.00	0.01
375	000792	盐湖股份	400	6,980.00	0.01
376	000807	云铝股份	500	6,755.00	0.01
377	600988	赤峰黄金	400	6,536.00	0.01
378	300707	威唐工业	500	6,190.00	0.01
379	002478	常宝股份	1,200	5,976.00	0.01
380	601595	上海电影	300	5,934.00	0.01
381	600867	通化东宝	700	5,859.00	0.01
382	000999	华润三九	130	5,535.40	0.01
383	002483	润邦股份	1,100	4,961.00	0.01
384	600233	圆通速递	300	4,695.00	0.01
385	603658	安图生物	100	4,607.00	0.01
386	300908	仲景食品	143	3,972.54	0.01
387	605296	神农集团	100	3,515.00	0.01
388	002030	达安基因	700	3,500.00	0.01
389	603477	巨星农牧	100	2,870.00	0.01
390	605333	沪光股份	100	2,785.00	0.01
391	300048	合康新能	500	2,315.00	0.00
392	603138	海量数据	200	2,096.00	0.00
393	603096	新经典	100	1,690.00	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	600519	贵州茅台	1,172,651.00	1.87
2	000333	美的集团	1,082,130.00	1.73
3	300750	宁德时代	1,026,446.00	1.64
4	300122	智飞生物	1,021,962.00	1.63
5	300394	天孚通信	1,021,259.30	1.63
6	600941	中国移动	1,004,793.00	1.61
7	688012	中微公司	1,003,911.61	1.60

8	002475	立讯精密	992,891.00	1.59
9	002371	北方华创	948,686.00	1.52
10	600276	恒瑞医药	927,872.00	1.48
11	603501	韦尔股份	885,517.00	1.41
12	000651	格力电器	873,732.00	1.40
13	300308	中际旭创	855,030.00	1.37
14	300502	新易盛	818,022.00	1.31
15	000858	五粮液	805,911.00	1.29
16	300760	迈瑞医疗	764,479.00	1.22
17	002179	中航光电	749,929.00	1.20
18	603160	汇顶科技	748,219.00	1.20
19	300782	卓胜微	739,918.00	1.18
20	000975	银泰黄金	733,066.00	1.17

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000568	泸州老窖	1,369,767.00	2.19
2	300750	宁德时代	1,319,408.00	2.11
3	000333	美的集团	1,249,889.00	2.00
4	002475	立讯精密	1,048,940.00	1.68
5	601138	工业富联	969,791.00	1.55
6	603259	药明康德	919,343.00	1.47
7	002555	三七互娱	846,347.00	1.35
8	600938	中国海油	845,142.00	1.35
9	000858	五粮液	842,321.00	1.35
10	600887	伊利股份	836,723.00	1.34
11	601006	大秦铁路	830,595.00	1.33
12	002821	凯莱英	825,984.00	1.32
13	300394	天孚通信	808,727.00	1.29
14	300122	智飞生物	804,117.00	1.28
15	600161	天坛生物	766,529.60	1.22
16	688012	中微公司	743,755.10	1.19
17	300308	中际旭创	734,723.80	1.17
18	603993	洛阳钼业	710,245.00	1.13
19	601688	华泰证券	703,600.00	1.12
20	300502	新易盛	694,009.00	1.11

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	210,553,829.86
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	215,830,197.40
--------------	----------------

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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，如期权、权证以及其他相关的衍生工具。本基金投资股指期货、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，如期权、权证以及其他相关的衍生工具。本基金投资股指期货、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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,895.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,311.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,207.07

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

份额级别	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 (%)
景顺长城量化平衡混合 A	2,392	21,244.67	0.00	0.00	50,817,257.22	100.00
景顺长城量化平衡混合 C	9	2,182.07	0.00	0.00	19,638.61	100.00
合计	2,401	21,173.22	0.00	0.00	50,836,895.83	100.00

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采

用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	景顺长城量化平衡混合 A	99.99	0.000197
	景顺长城量化平衡混合 C	12.91	0.065738
	合计	112.90	0.000222

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

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

项目	景顺长城量化平衡混合 A	景顺长城量化平衡混合 C
基金合同生效日 （2017 年 12 月 27 日）基金份额总额	1,252,624,403.22	—
本报告期期初基金份额总额	55,888,742.26	20,032.37
本报告期基金总申购份额	472,375.83	68,994.21
减：本报告期基金总赎回份额	5,543,860.87	69,387.97
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	50,817,257.22	19,638.61

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安证券股份有限公司	2	85,627,492.00	20.08	80,993.36	20.21	-
山西证券股份有限公司	2	65,715,964.60	15.41	62,161.99	15.51	本期报告新增2个
华泰证券股份有限公司	2	40,225,488.87	9.43	38,048.38	9.49	-
财通证券股份有限公司	1	38,477,557.74	9.02	36,398.78	9.08	-
东吴证券	2	24,992,414.49	5.86	23,641.34	5.90	-

股份有限 公司						
信达证券 股份有限 公司	2	24,179,277.57	5.67	22,872.15	5.71	-
长江证券 股份有限 公司	2	21,839,245.36	5.12	20,657.80	5.15	-
方正证券 股份有限 公司	2	19,415,242.00	4.55	18,365.06	4.58	-
摩根大通 证券(中 国)有限公 司	1	14,612,999.45	3.43	13,822.95	3.45	-
川财证券 有限责任 公司	1	13,957,902.00	3.27	13,202.72	3.29	-
华鑫证券 股份有限 公司	1	13,650,336.90	3.20	12,912.08	3.22	-
华安证券 股份有限 公司	1	13,608,474.30	3.19	12,872.92	3.21	-
首创证券 股份有限 公司	2	12,487,928.64	2.93	11,812.63	2.95	-
中信证券 股份有限 公司	3	12,413,419.22	2.91	9,259.20	2.31	-
德邦证券 股份有限 公司	2	10,874,517.28	2.55	10,286.56	2.57	-
中泰证券 股份有限 公司	2	8,626,147.10	2.02	8,159.85	2.04	-
广发证券 股份有限 公司	1	5,679,619.74	1.33	5,372.85	1.34	-
国海证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华兴证券 有限公司	1	-	-	-	-	-

江海证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
五矿证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)

国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	7,423.25	100.00	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券(中国)有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

华安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
首创证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
德邦证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国海证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华兴证 券有限 公司	-	-	-	-	-	-
江海证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
平安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券股 份有限 公司	-	-	-	-	-	-
五矿证 券有限	-	-	-	-	-	-

公司						
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	景顺长城基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月19日
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2023年第4季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月22日
4	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月22日
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月22日
6	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
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2023年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月29日
8	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月29日
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月13日
10	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
11	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月22日
12	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
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年5月21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5月24日
15	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证	中国证监会指定报刊及	2024年5月25日

	券投资基金基金产品资料概要更新	网站	
16	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金 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 5 月 25 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 31 日
18	景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 14 日
19	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
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城量化平衡灵活配置混合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

2024 年 8 月 30 日