

景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券 投资基金（QDII-LOF）

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 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	7
2.6 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布	40

7.3 期末按行业分类的权益投资组合	40
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	40
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	40
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	41
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	41
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	41
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	41
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	41
7.11 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末上市基金前十名持有人	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	44
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金(QDII-LOF)	
基金简称	景顺长城全球半导体芯片股票(QDII-LOF)	
场内简称	全球芯片 LOF	
基金主代码	501225	
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)	
基金合同生效日	2023年3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	
报告期末基金份额总额	350,536,400.31份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2023年4月14日	
下属分级基金的基金简称	景顺长城全球半导体芯片股票A (QDII-LOF)(人民币)	景顺长城全球半导体芯片股票C (QDII-LOF)(人民币)
下属分级基金的交易代码	501225	016668
报告期末下属分级基金的份额总额	252,825,541.25份	97,710,859.06份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制组合风险与保持资产流动性的基础上，主要投资于全球范围内半导体芯片产业主题相关的公募基金的基金份额和相关上市公司，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、国家与地区配置策略</p> <p>本基金在全球范围内进行投资，采用“自上而下”方法进行国家及地区的资产配置。本基金将综合运用定性和定量分析方法，分析各个国家及地区的人口结构、宏观经济形势、经济政策等，以及各个市场估值水平，并结合各市场的风险水平，动态地确定基金资产在各个国家及地区的资产配置。</p> <p>2、主题界定</p> <p>本基金采取主题投资策略，本基金的半导体芯片产业主题的界定如下：(1)对于股票型基金，主要指境内外跟踪半导体或芯片产业相关指数的ETF或者指数型证券投资基金；(2)对于股票，主要投资于境内外半导体或芯片产业相关指数的成份股及其备选成份股。</p> <p>3、基金投资策略</p> <p>本基金在全球范围内精选跟踪全球半导体芯片产业的主题基金（含ETF和其它指数型证券投资基金），通过定量分析和定性分析相结合的方式筛选标的基金。</p> <p>4、股票投资策略</p> <p>本基金将挑选出境内外半导体或芯片产业具有代表性的相关指数，采用抽样复制和动态最优化的方法，选取相关指数成份股和备选成份股中流动性较好的股票，构造与本基金主题投资相匹配和风险收</p>

	<p>益特征相似的股票组合，进行被动式投资。</p> <p>5、存托凭证投资策略</p> <p>本基金的存托凭证投资将根据本基金的投资目标和上述股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，通过定性和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。</p> <p>6、金融衍生品投资策略</p> <p>本基金将按照风险管理的原则，谨慎参与各类金融衍生品投资，将适度投资于经中国证监会允许的各类金融衍生品，如期货、期权、权证、远期合约、掉期、结构性投资产品以及其他衍生工具。</p> <p>7、债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。</p> <p>8、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，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。</p>
业绩比较基准	中证芯片产业指数收益率*15%+费城半导体指数收益率 (PHLX Semiconductor Sector Index) (使用估值汇率调整)*75%+人民币活期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金投资于 ETF 的比例不低于本基金资产的 80%，投资于本基金界定的半导体芯片产业主题的权益类资产(包括股票、股票型基金)的比例不低于本基金非现金资产部分的 80%，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型证券投资基金、债券型证券投资基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	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 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.igwfmc.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1日-2024年6月30日)	
	景顺长城全球半导体芯片股票 A (QDII-LOF) (人民币)	景顺长城全球半导体芯片股票 C (QDII-LOF) (人民币)
本期已实现收益	12,313,185.93	3,482,959.95
本期利润	37,947,457.66	15,260,014.72
加权平均基金份额本期利润	0.1578	0.1992
本期加权平均净值利润率	12.36%	15.86%
本期基金份额净值增长率	21.51%	21.23%
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	10,340,038.92	3,413,723.73
期末可供分配基金份额利润	0.0409	0.0349
期末基金资产净值	357,920,868.08	137,522,753.41
期末基金份额净值	1.4156	1.4074
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	41.56%	40.74%

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

景顺长城全球半导体芯片股票 A (QDII-LOF) (人民币)

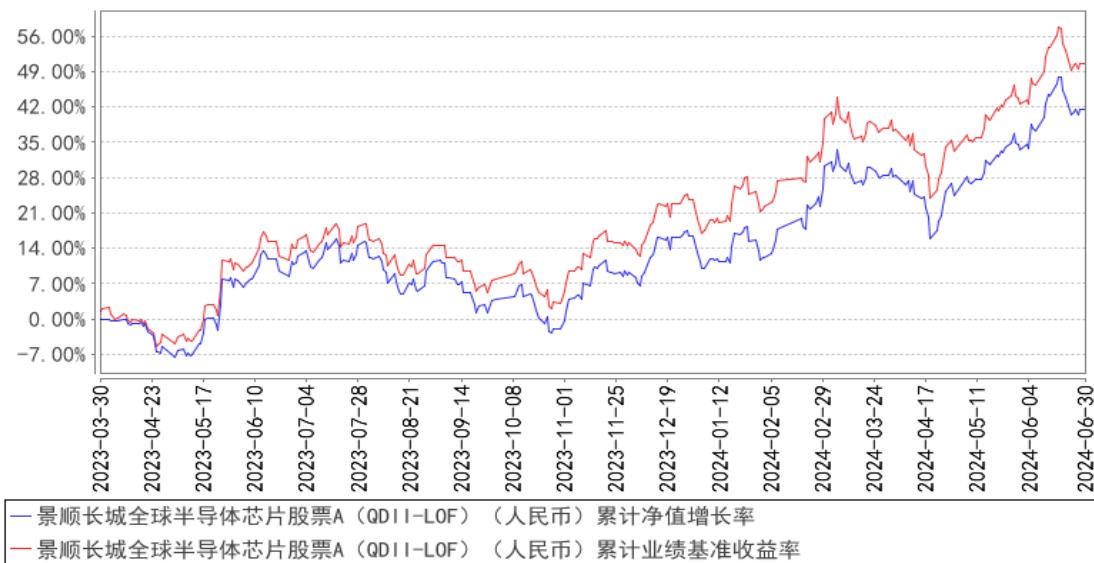
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.04%	1.37%	5.78%	1.40%	0.26%	-0.03%
过去三个月	10.21%	1.38%	9.35%	1.38%	0.86%	0.00%
过去六个月	21.51%	1.42%	21.78%	1.43%	-0.27%	-0.01%
过去一年	25.75%	1.33%	30.22%	1.34%	-4.47%	-0.01%
自基金合同生效起至今	41.56%	1.36%	50.71%	1.37%	-9.15%	-0.01%

景顺长城全球半导体芯片股票 C (QDII-LOF) (人民币)

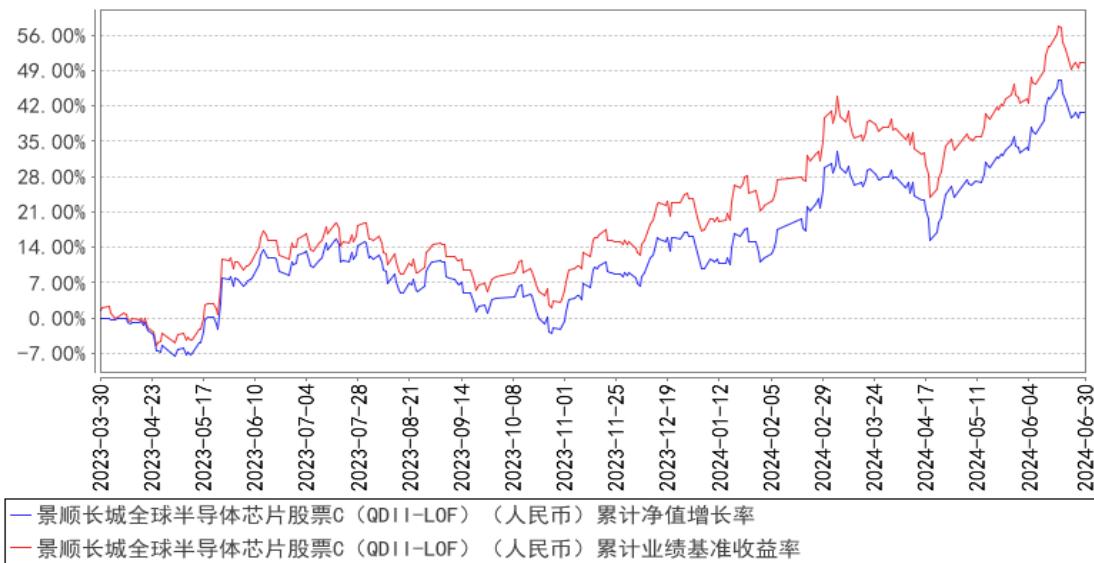
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.00%	1.37%	5.78%	1.40%	0.22%	-0.03%
过去三个月	10.09%	1.37%	9.35%	1.38%	0.74%	-0.01%
过去六个月	21.23%	1.42%	21.78%	1.43%	-0.55%	-0.01%
过去一年	25.17%	1.33%	30.22%	1.34%	-5.05%	-0.01%
自基金合同生效起至今	40.74%	1.36%	50.71%	1.37%	-9.97%	-0.01%

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

景顺长城全球半导体芯片股票A（QDII-LOF）（人民币）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



景顺长城全球半导体芯片股票C（QDII-LOF）（人民币）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：本基金投资于 ETF 的比例不低于本基金资产的 80%; 投资于境外资产的比例不低于本基金资产的 20%; 投资于境内资产的比例不低于本基金资产的 20%; 投资于权益类资产（包括股票、股票型基金）的比例不低于本基金资产的 80%; 投资于本基金界定的半导体芯片产业主题的权益类资产（包括股票、股票型基金）的比例不低于本基金非现金资产部分的 80%。每个交易日日终在扣除应缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2023 年 3 月 30 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金

金投资组合达到上述投资组合比例的要求。报告期末距离建仓结束期未满一年。

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	2023年6 月30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。
金璜	本基金的 基金经理	2024年1 月19日	-	8年	工学硕士，CFA。曾任美国AltvestPersonalWealthManagement(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。
张晓南	本基金的基金经理	2023年3月30日	2024年5月29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	本基金的基金助理	2023年9月13日	2024年1月18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遵规守信情况的说明

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管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金(QDII-LOF)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AI相关产业投资热情依旧高涨，美股科技板块风险偏好仍处于高位，美股科技龙头带领主要股指继续上涨。主要海外市场指数中，纳斯达克科技市值加权(33.60%)>费城半导体指数(31.06%)>纳斯达克100(16.98%)>标普500(14.48%)>英国富时100(5.57%)>恒生指数(3.94%)>道琼斯工业指数(3.79%)>罗素2000指数(1.02%)>恒生科技(-5.57%)。

今年二季度初美股在经历短暂回调后，开启了连续上涨的模式，资产价格连续上涨得益于宏观流动性、企业盈利及市场情绪提振的多重利好。宏观方面，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%。盈利能力方面，根据彭博的数据，约标普500指数成份股中约有81%的一季度披露战胜了盈利预测。盈利能力的普遍改善在分子端上为美股本季度上涨继续提供动力。从市场情绪看，以美股科技龙头为代表的大盘成长股继续保持较高水平的日均成交，美股的资金关注度和交投活跃度依然保持在高位。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

2024年上半年，景顺长城全球半导体芯片股票（QDII-LOF）A类份额净值增长率为21.51%，

业绩比较基准收益率为 21.78%。

2024 年上半，景顺长城全球半导体芯片股票（QDII-LOF）C 类份额净值增长率为 21.23%，业绩比较基准收益率为 21.78%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

伴随着降息预期和盈利改善的巩固，美股资产依然具有一定吸引力。以人工智能为代表的科技创新正在如火如荼的发展，相关创新及应用正加速落地，预计科技板块有望继续保持强势。境外投资作为国内居民资产配置必不可少的一环，建议保持对海外科技类投资产品的关注。

本基金在严格控制组合风险与保持资产流动性的基础上，主要投资于全球范围内半导体芯片产业主题相关的公募基金的基金份额和相关上市公司，力争实现基金资产的长期稳健增值。在报告期内，本基金结合申购赎回情况、相关标的与基准指数的相关性情况等定期或不定期调整投资组合，实现对全球半导体芯片产业的有效风险暴露。

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，控制执行中可能产生的风险。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

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：景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）

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	37,434,157.11	51,447,957.55
结算备付金		-	259,487.34
存出保证金		38,382.57	18,380.81
交易性金融资产	6.4.7.2	458,925,360.11	226,848,564.73
其中：股票投资		-	133,716.00
基金投资		458,925,360.11	226,714,848.73

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		1, 234, 681. 30	-
应收股利		-	-
应收申购款		11, 352, 159. 74	7, 421, 163. 06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	-	-
资产总计		508, 984, 740. 83	285, 995, 553. 49
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		2, 441, 040. 89	31, 762, 152. 16
应付赎回款		10, 377, 876. 32	5, 251, 379. 14
应付管理人报酬		363, 424. 79	154, 552. 76
应付托管费		90, 027. 23	43, 888. 19
应付销售服务费		35, 742. 13	28, 605. 39
应付投资顾问费		-	-
应交税费		141, 521. 06	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 9	91, 486. 92	161, 046. 97
负债合计		13, 541, 119. 34	37, 401, 624. 61
净资产：			
实收基金	6. 4. 7. 10	350, 536, 400. 31	213, 637, 202. 77
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	144, 907, 221. 18	34, 956, 726. 11
净资产合计		495, 443, 621. 49	248, 593, 928. 88
负债和净资产总计		508, 984, 740. 83	285, 995, 553. 49

注： 报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 350, 536, 400. 31 份，其中本基金 A 类份额净

值人民币 1.4156 元，基金份额 252,817,719.34 份；本基金 A 类美元现汇份额净值美元 0.1986 元，基金份额 7,821.91 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.4074 元，基金份额 97,710,859.06 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）

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 3 月 30 日（基 金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业收入		56,004,803.99	25,099,442.30
1. 利息收入		157,642.65	199,454.56
其中：存款利息收入	6.4.7.13	157,642.65	199,454.56
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）		17,804,977.73	-1,975,680.98
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,926.44	-
基金投资收益	6.4.7.15	17,370,263.93	-2,142,616.77
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	436,640.24	166,935.79
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	37,411,326.50	25,282,715.71
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-1,578,089.05	-322,147.07
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.22	2,208,946.16	1,915,100.08
减：二、营业总支出		2,797,331.61	1,134,697.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,936,977.37	825,404.17
其中：暂估管理人报酬		-	-

2. 托管费	6.4.10.2.2	494,946.09	182,999.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	189,857.78	52,403.80
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		62,567.53	-
8. 其他费用	6.4.7.24	112,982.84	73,889.16
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		53,207,472.38	23,964,745.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		53,207,472.38	23,964,745.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		53,207,472.38	23,964,745.22

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）

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	213,637,202.77	-	34,956,726.11	248,593,928.88
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	213,637,202.77	-	34,956,726.11	248,593,928.88
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	136,899,197.54	-	109,950,495.07	246,849,692.61
(一)、综合收益总额	-	-	53,207,472.38	53,207,472.38
(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)	136,899,197.54	-	56,743,022.69	193,642,220.23

其中: 1. 基金申购款	484,808,018.06	-	143,412,879.63	628,220,897.69
2. 基金赎回款	-347,908,820.52	-	-86,669,856.94	-434,578,677.46
(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	350,536,400.31	-	144,907,221.18	495,443,621.49
项目	上年度可比期间			
	2023年3月30日(基金合同生效日)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	-	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	402,990,053.76	-	-	402,990,053.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-150,681,260.24	-	31,624,593.81	-119,056,666.43
(一)、综合收益总额	-	-	23,964,745.22	23,964,745.22
(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)	-150,681,260.24	-	7,659,848.59	-143,021,411.65
其中: 1. 基金申购款	129,270,305.49	-	11,086,236.74	140,356,542.23
2. 基金赎回款	-279,951,565.73	-	-3,426,388.15	-283,377,953.88
(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	252,308,793.52	-	31,624,593.81	283,933,387.33

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

景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金(QDII-LOF)(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[2022]第 1927 号《关于准予景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金(QDII-LOF)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《景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 402,909,525.52 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(2023)第 0183 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》于 2023 年 3 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 402,990,053.76 份基金份额,其中认购资金利息折合 80,528.24 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,基金托管人为招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。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]第 66 号文审核同意,本基金 308,190,396.00 份 A 类人民币份额于 2023 年 4 月 14 日在上交所挂牌交易。未上市交易的 A 类人民币份额托管在场外,A 类人民币份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至上交所场内后即可上市流通。本基金 C 类基金份额不上市交易,且暂不开通跨系统转托管业务。

根据《景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》和《景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金(QDII-LOF)招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、

销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额，A类基金份额根据所使用货币的不同，再分为A类人民币份额和A类美元现汇份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为C类基金份额。本基金各类基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值。

投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》的有关规定，针对境外市场，本基金的投资范围包括法律法规允许的、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、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、期货等金融衍生工具。针对境内市场，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(含ETF和LOF)、国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板以及其他中国证监会允许上市的股票和存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具及其他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。本基金的投资组合比例为：ETF投资不少于基金资产的80%，投资于境外资产的比例不低于本基金资产的20%；投资于境内资产的比例不低于本基金资产的20%；投资于权益类资产(包括股票、股票型基金)的比例不低于本基金资产的80%，投资于本基金界定的半导体芯片产业主题的权益类资产(包括股票、股票型基金)的比例不低于本基金非现金资产部分的80%；每个交易日日终在扣除应缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例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。本基金的业绩比较基准为：中证芯片产业指数收益率*15%+费城半导体指数收益率(PHLX Semiconductor Sector Index)(使用估值汇率调整)*75%+人民

人民币活期存款利率(税后)X10%

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于2024年8月28日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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	37,434,157.11
等于：本金	37,432,232.90
加：应计利息	1,924.21

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	37,434,157.11

注：于2024年6月30日，银行存款中包含的外币余额为：美元2.91元(折合人民币20.74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	-	-	-	-
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	394,314,207.96	-	458,925,360.11	64,611,152.15
其他	-	-	-	-
合计	394,314,207.96	-	458,925,360.11	64,611,152.15

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	1,979.32
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	89,507.60
合计	91,486.92

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城全球半导体芯片股票 A (QDII-LOF) (人民币)

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	137,316,992.90	137,316,992.90
本期申购	374,311,658.42	374,311,658.42
本期赎回(以“-”号填列)	-258,803,110.07	-258,803,110.07
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	252,825,541.25	252,825,541.25

景顺长城全球半导体芯片股票 C (QDII-LOF) (人民币)

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	76,320,209.87	76,320,209.87
本期申购	110,496,359.64	110,496,359.64
本期赎回(以“-”号填列)	-89,105,710.45	-89,105,710.45
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	97,710,859.06	97,710,859.06

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

景顺长城全球半导体芯片股票 A (QDII-LOF) (人民币)

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,782,118.02	24,451,545.66	22,669,427.64
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,782,118.02	24,451,545.66	22,669,427.64
本期利润	12,313,185.93	25,634,271.73	37,947,457.66
本期基金份额交易产生的变动数	-191,028.99	44,669,470.52	44,478,441.53
其中：基金申购款	-1,411,576.04	113,027,232.50	111,615,656.46

基金赎回款	1,220,547.05	-68,357,761.98	-67,137,214.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,340,038.92	94,755,287.91	105,095,326.83

景顺长城全球半导体芯片股票C(QDII-LOF)(人民币)

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,233,861.11	13,521,159.58	12,287,298.47
加: 会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,233,861.11	13,521,159.58	12,287,298.47
本期利润	3,482,959.95	11,777,054.77	15,260,014.72
本期基金份额交易产生的变动数	1,164,624.89	11,099,956.27	12,264,581.16
其中: 基金申购款	374,477.56	31,422,745.61	31,797,223.17
基金赎回款	790,147.33	-20,322,789.34	-19,532,642.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,413,723.73	36,398,170.62	39,811,894.35

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	155,742.31
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,527.83
其他	372.51
合计	157,642.65

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	-1,926.44
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,926.44

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	132,053.00
减：卖出股票成本总额	133,780.00
减：交易费用	199.44
买卖股票差价收入	-1,926.44

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	292,591,254.91
减：卖出/赎回基金成本总额	274,689,988.19
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	521,396.12
减：交易费用	9,606.67
基金投资收益	17,370,263.93

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1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	436,640.24
合计	436,640.24

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1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	37,411,326.50
股票投资	64.00
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	37,411,262.50
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	37,411,326.50

6.4.7.22 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	2,208,946.16
合计	2,208,946.16

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1日至2024年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	23,475.24
合计	112,982.84

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、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
景顺资产管理有限公司（“景顺（Invesco）”）	基金管理人的股东
香港上海汇丰银行有限公司（“汇丰银行”）	境外资产托管人

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1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年3月30日(基金合 同生效日)至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,936,977.37	825,404.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	716,638.72	281,627.43
应支付基金管理人的净管理费	1,220,338.65	543,776.74

注：本基金投资于基金管理人所管理的基金部分不收取管理费；本基金资产中投资于本基金管理人股东景顺（Invesco）管理的基金的部分按照本基金管理人股东景顺（Invesco）实际收取的管理费从基金管理人应收取的管理费中扣减（实际收取部分以所投资基金公告的管理费率计算扣减，若为负数，则取0）。支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有本基金管理人管理的基金的基金份额的资产后的余额（若为负数，则取0）的1.20%年费率（投资于本基金管理人股东景顺（Invesco）管理的基金的部分按照本基金管理人股东景顺（Invesco）实际收取的管理费从基金管理人应收取的管理费中扣减，实际收取部分以所投资基金公告的管理费率计算扣减，若为负数，则取0）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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分（投资于本基金管理人股东景顺（Invesco）管理的基金的部分按照本基金管理人股东景顺（Invesco）实际收取的管理费从基金管理人应收取的管理费中扣减，实际收取部分以所投资基金公告的管理费率计算扣减）后的余额X1.20%/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3月30日(基金合 同生效日)至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	494,946.09	182,999.95

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额

X0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城全球半导体 芯片股票A (QDII-LOF) (人民 币)	景顺长城全球半导体 芯片股票C (QDII-LOF) (人民 币)	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	1,663.94	1,663.94
招商银行	-	26,402.40	26,402.40
长城证券	-	0.53	0.53
合计	-	28,066.87	28,066.87
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年3月30日(基金合同生效日)至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城全球半导体 芯片股票A (QDII-LOF) (人民 币)	景顺长城全球半导体 芯片股票C (QDII-LOF) (人民 币)	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	57.78	57.78
招商银行	-	2,596.98	2,596.98
长城证券	-	-	-
合计	-	2,654.76	2,654.76

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.40%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X0.40%/当年天数。

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

本基金本报告期内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

本基金于本报告期内及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年3月30日(基金合同生效日)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
汇丰银行-活期	13,185,275.82	106,151.66	13,462,509.73	123,473.64
招商银行-活期	24,248,881.29	49,590.65	12,961,816.34	74,269.87

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

于2024年6月30日，本基金持有基金管理人股东景顺(Invesco)所管理的公开募集证券投资基金合计170,026,986.16元，占本基金资产净值的比例为34.32%；持有基金管理人景顺长城基金管理有限公司所管理的公开募集证券投资基金合计26,715,000.00元，占本基金资产净值的比例为5.39%（于2023年12月31日，本基金持有基金管理人股东景顺(Invesco)所管理的公开募集证券投资基金合计71,188,900.62元，占本基金资产净值的比例为28.64%；持有基金管理人景顺长城基金管理有限公司所管理的公开募集证券投资基金合计42,695,316.01元，占本基金资产净值的比例为17.17%）。

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公司发行的证券，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：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理规定》(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公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流

通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人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，并按照合约规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	37,434,157.11	-	-	-	-	-	37,434,157.11
存出保证金	38,382.57	-	-	-	-	-	38,382.57
交易性金融资产	-	-	-	-	458,925,360.11	458,925,360.11	

应收申购款	92,549.87	-	-	-	-	11,259,609.87	11,352,159.74
应收清算款	-	-	-	-	-	1,234,681.30	1,234,681.30
资产总计	37,565,089.55	-	-	-	-	471,419,651.28	508,984,740.83
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,377,876.32	10,377,876.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	363,424.79	363,424.79
应付托管费	-	-	-	-	-	90,027.23	90,027.23
应付清算款	-	-	-	-	-	2,441,040.89	2,441,040.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-	35,742.13	35,742.13
应交税费	-	-	-	-	-	141,521.06	141,521.06
其他负债	-	-	-	-	-	91,486.92	91,486.92
负债总计	-	-	-	-	-	13,541,119.34	13,541,119.34
利率敏感度缺口	37,565,089.55	-	-	-	-	-	-
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	51,447,957.55	-	-	-	-	-	51,447,957.55
结算备付金	259,487.34	-	-	-	-	-	259,487.34
存出保证金	18,380.81	-	-	-	-	-	18,380.81
交易性金融资产	-	-	-	-	-	226,848,564.73	226,848,564.73
应收申购款	622.51	-	-	-	-	7,420,540.55	7,421,163.06
资产总计	51,726,448.21	-	-	-	-	234,269,105.28	285,995,553.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,251,379.14	5,251,379.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	154,552.76	154,552.76
应付托管费	-	-	-	-	-	43,888.19	43,888.19
应付清算款	-	-	-	-	-	31,762,152.16	31,762,152.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-	28,605.39	28,605.39
其他负债	-	-	-	-	-	161,046.97	161,046.97
负债总计	-	-	-	-	-	37,401,624.61	37,401,624.61
利率敏感度缺口	51,726,448.21	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	20.74	-	-	20.74
交易性金融资产	344,034,040.05	-	8,832,544.96	352,866,585.01
资产合计	344,034,060.79	-	8,832,544.96	352,866,605.75
以外币计价的负债				
应付清算款	2,441,040.89	-	-	2,441,040.89
负债合计	2,441,040.89	-	-	2,441,040.89
资产负债表外汇风险敞口净额	341,593,019.90	-	8,832,544.96	350,425,564.86
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	33,927,080.59	-	-	33,927,080.59
交易性金融资产	175,661,536.32	-	-	175,661,536.32
资产合计	209,588,616.91	-	-	209,588,616.91
以外币计价的负债				
应付清算款	25,064,823.46	-	-	25,064,823.46
负债合计	25,064,823.46	-	-	25,064,823.46
资产负债表外汇风险敞口净额	184,523,793.45	-	-	184,523,793.45

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)	上年度末(2023年12月31日)
	所有外币相对人民币升值 5%	17,521,278.24	9,226,189.67
	所有外币相对人民币贬值 5%	-17,521,278.24	-9,226,189.67

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	-	-	133,716.00	0.05
交易性金融资产—基金投资	458,925,360.11	92.63	226,714,848.73	91.20
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	458,925,360.11	92.63	226,848,564.73	91.25

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2024年6月30日)	上年度末(2023年12月31日)
	沪深300指数上升5%	11,095,028.23	3,606,420.98
	沪深300指数下降5%	-11,095,028.23	-3,606,420.98

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	458,925,360.11	226,848,564.73
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	458,925,360.11	226,848,564.73

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	458,925,360.11	90.16
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	37,434,157.11	7.35
8	其他各项资产	12,625,223.61	2.48
9	合计	508,984,740.83	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

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

本基金本报告期末未持有权益投资。

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初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

本基金报告期内无买入权益投资。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	Naura Technology Group Co., Ltd.	002371 SZ	24,236.00	0.01
2	Unigroup Guoxin Microelectronics Co., Ltd.	002049 SZ	19,899.00	0.01
3	Maxscend Microelectronics Company Limited	300782 SZ	13,345.00	0.01
4	Empyrean Technology Co., Ltd.	301269 SZ	10,586.00	0.00
5	Tongfu Microelectronics Co., Ltd.	002156 SZ	9,276.00	0.00
6	Sg Micro Corp	300661 SZ	8,850.00	0.00
7	Tianshui Huatian	002185 SZ	7,596.00	0.00

	Technology Co., Ltd.			
8	Hangzhou Chang Chuan Technology Co., Ltd.	300604 SZ	7,425.00	0.00
9	Changsha Jingjia Microelectronics Co., Ltd.	300474 SZ	7,042.00	0.00
10	Ingenic Semiconductor Co., Ltd.	300223 SZ	6,336.00	0.00
11	Hunan Goke Microelectronics Co., Ltd.	300672 SZ	6,065.00	0.00
12	Konfoong Materials International Co., Ltd.	300666 SZ	5,875.00	0.00
13	Jiangsu Nata Opto-Electronic Material Co., Ltd.	300346 SZ	5,522.00	0.00

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交量），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	-
卖出收入(成交)总额	132,053.00

注：买入成本、卖出收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	iShares Semiconductor ETF	股票型	交易型开放式(ETF)	BlackRock Fund Advisors	87,833,161.40	17.73

2	Invesco Dynamic Semiconductors	股票型	交易型开放式(ETF)	Invesco Capital Management LLC	87,573,833.11	17.68
3	VanEck Semiconductor ETF	股票型	交易型开放式(ETF)	Van Eck Associates Corporation	86,173,892.49	17.39
4	Invesco PHLX Semiconductor ETF	股票型	交易型开放式(ETF)	Invesco Capital Management LLC	82,453,153.05	16.64
5	国泰CES半导体芯片行业ETF	股票型	交易型开放式(ETF)	国泰基金管理有限公司	40,031,258.30	8.08
6	华夏国证半导体芯片ETF	股票型	交易型开放式(ETF)	华夏基金管理有限公司	39,312,516.80	7.93
7	景顺长城中证芯片产业ETF	股票型	交易型开放式(ETF)	景顺长城基金管理有限公司	26,715,000.00	5.39
8	Global X Semiconductor ETF/Jap	股票型	交易型开放式(ETF)	Global X Japan Co Ltd	8,832,544.96	1.78

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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	38,382.57
2	应收清算款	1,234,681.30
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,352,159.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	12,625,223.61
---	----	---------------

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

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(%)
景顺长城全球半导体芯片股票 A (QDII-LOF) (人民币)	32,770	7,715.15	53,206,308.69	21.04	199,619,232.56	78.96
景顺长城全球半导体芯片股票 C (QDII-LOF) (人民币)	36,798	2,655.33	777,334.10	0.80	96,933,524.96	99.20
合计	69,568	5,038.76	53,983,642.79	15.40	296,552,757.52	84.60

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	陆家嘴国际信托有限公司	5,825,493.00	2.80
2	歌斐诺宝(上海)资产管理有限公司—歌斐目标策略平衡型私募证券投资基金	5,238,965	2.52
3	华泰证券股份有限公司	5,032,755	2.42
4	上海玺树投资管理有限公司—玺树投资	4,574,089	2.20

	传世精选混合型证券投资私募基金		
5	缪文	4,276,606	2.06
6	上海曦微资产管理中心（有限合伙）—曦微成长精选1期（新）基金	4,200,000	2.02
7	周靖挺	3,399,818	1.63
8	上海宁苑资产管理有限公司—宁苑沛华稳定增长一号私募证券投资基金	3,376,931	1.62
9	方正证券股份有限公司	2,774,373	1.33
10	上海曦微资产管理中心（有限合伙）—曦微成长精选2期基金	2,700,000	1.30

8.3 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	景顺长城全球半导体芯片股票A（QDII-LOF）（人民币）	89,119.34	0.035249
	景顺长城全球半导体芯片股票C（QDII-LOF）（人民币）	195,681.31	0.200266
	合计	284,800.65	0.081247

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金经理和研究部门负责人持有本开放式基金	景顺长城全球半导体芯片股票A（QDII-LOF）（人民币）	—
	景顺长城全球半导体芯片股票C（QDII-LOF）（人民币）	—
	合计	—
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城全球半导体芯片股票A（QDII-LOF）（人民币）	0~10
	景顺长城全球半导体芯片股票C（QDII-LOF）（人民币）	10~50
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城全球半导体芯片股票A（QDII-LOF）（人民币）	景顺长城全球半导体芯片股票C（QDII-LOF）（人民币）
基金合同生效日 (2023年3月30日)	351,406,242.21	51,583,811.55
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	137,316,992.90	76,320,209.87
本报告期基金总申购份额	374,311,658.42	110,496,359.64

减：本报告期基金总 赎回份额	258,803,110.07	89,105,710.45
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	252,825,541.25	97,710,859.06

注：1. 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金份额变动含人民币份额及美元现汇份额。

§ 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

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

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 (%)	
东吴证券 股份有限 公司	2	132,053.00	100.00	124.89	100.00	-
CLSA Limited	1	-	-	-	-	-
Jane Street Financial Ltd	1	-	-	-	-	-
Optiver Australia Pty Limited	1	-	-	-	-	-
财通证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
川财证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国海证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
华安证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华兴证券有限公司	1	-	-	-	-	-
华鑫证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
江海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
摩根大通证券（中国）有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期报告新增2个
首创证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	2	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中信证券股份有限	3	-	-	-	-	-

公司						
Susquehana Hong Kong Limited	1	-	-	-	-	本期报告新增1个

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		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(%)
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	14,840,328.40	1.95
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	79,488,165.60	10.43
Jane Street Financial Ltd	-	-	-	-	-	-	311,037,547.99	40.81
Optiver Australia	-	-	-	-	-	-	111,771,331.78	14.67

Pty Limited								
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	19,794,518.00	2.60
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	6,523,718.16	0.86
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	2,819,699.80	0.37
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	16,560,891.12	2.17
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	65,632,370.91	8.61
华安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	1,213,959.40	0.16
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	10,770,260.90	1.41
江海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	6,670.40	0.00
摩根大通证券(中国)有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	12,461,227.50	1.64
首创证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	56,988,986.70	7.48
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	11,693,950.11	1.53

中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	10,719,727.82	1.41
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	10,161,863.76	1.33
Susquehanna Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	19,595,273.63	2.57

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增玄元保险为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月5日
2	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
3	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月19日
4	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
5	景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）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
6	景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）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1月23日
7	景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月23日
8	关于景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）暂停（大额）申购（含日常申购和定期定额投资）的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月24日
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月24日
10	关于景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）场外人民币A份额和C份额新增方正证券	中国证监会指定报刊及网站	2024年2月23日

	为销售机构的公告		
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增微众银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年2月23日
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏财富为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月1日
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民生证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月4日
14	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金(QDII-LOF)二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月12日
15	关于景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金(QDII-LOF)调整大额申购(含日常申购和定期定额投资)限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月12日
16	关于景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金(QDII-LOF)场外人民币A类份额和C类份额新增兴业证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月13日
17	关于景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金(QDII-LOF)场外人民币A类份额和C类份额新增山西证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月18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3月22日
19	关于景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金(QDII-LOF)场外人民币A类份额和C类份额新增平安证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月26日
20	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
21	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
22	景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金(QDII-LOF)2023年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月29日
23	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月13日
24	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
25	景顺长城全球半导体芯片产业股票型	中国证监会指定报刊及	2024年4月22日

	证券投资基金（QDII-LOF）2024年第1季度报告	网站	
26	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
27	关于景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）场外人民币A类份额和C类份额新增新浪仓石为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月23日
28	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增创金启富为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年5月8日
29	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
30	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年5月30日
31	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
32	景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）2024年第2号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2024年6月3日
33	景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）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3日
34	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
35	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全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）募集注册的文件；

- 2、《景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》；
- 3、《景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）招募说明书》；
- 4、《景顺长城全球半导体芯片产业股票型证券投资基金（QDII-LOF）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