

景顺长城大中华混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§ 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.....	7
3.3 其他指标.....	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作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.....	11
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.....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	41
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	41
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.....	42

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	44
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.11 投资组合报告附注.....	47
§ 8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
§ 9 开放式基金份额变动.....	49
§ 10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	56
§ 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.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城大中华混合型证券投资基金	
基金简称	景顺长城大中华混合（QDII）	
基金主代码	262001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 9 月 22 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	594,715,372.36 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城大中华混合（QDII）A 人民币	景顺长城大中华混合（QDII）C 人民币
下属分级基金的交易代码	262001	016988
报告期末下属分级基金的份额总额	587,023,911.16 份	7,691,461.20 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于除内地以外的大中华地区证券市场以及海外证券市场交易的大中华企业，追求长期资本增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的资产配置与“自下而上”的选股相结合的投资策略，在实际投资组合的构建上更偏重“自下而上”的部分，重点投资于处于合理价位的成长型股票（Growth at Reasonable Price, GARP）以及受惠于盈利周期加速且估值便宜的品质型股票（value + catalyst）。
业绩比较基准	摩根斯坦利金龙净总收益指数（MSCI Golden Dragon Net Total Return Index）。
风险收益特征	本基金是混合型基金，属于高预期风险、高预期收益的投资品种。其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。同时，本基金投资的目标市场是海外市场，除了需要承担市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、不同地区以及国别风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨崑阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95588
传真	0755-22381339	(010) 66105798

注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	李进	廖林

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Invesco Hong Kong Limited	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	景顺投资管理有限公司	渣打银行（香港）有限公司
注册地址		香港中环花园道三号冠君大厦 41 楼	香港中环德辅道中四至四 A 渣打银行大厦三十二楼
办公地址		香港中环花园道三号冠君大厦 41 楼	香港九龙官塘道 388 号渣打中心十五楼
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	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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)	
	景顺长城大中华混合（QDII）A 人民币	景顺长城大中华混合（QDII）C 人民币
本期已实现收益	-40,108,803.56	-496,836.67
本期利润	24,666,755.33	337,177.15
加权平均基金份额本期利润	0.0409	0.0461
本期加权平均净值利润率	2.44%	2.75%
本期基金份额净值增长率	2.56%	2.39%

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	-197,166,155.03	-2,664,427.53
期末可供分配基金份额利润	-0.3359	-0.3464
期末基金资产净值	1,035,203,650.34	13,492,661.47
期末基金份额净值	1.763	1.754
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	127.36%	1.50%

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三位，小数点后第四位四舍五入，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

景顺长城大中华混合（QDII）A 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	0.34%	0.95%	2.77%	0.97%	-2.43%	-0.02%
过去三个月	8.23%	1.12%	9.64%	1.24%	-1.41%	-0.12%
过去六个月	2.56%	1.29%	11.59%	1.24%	-9.03%	0.05%
过去一年	-1.89%	1.23%	9.56%	1.21%	-11.45%	0.02%
过去三年	-33.60%	1.49%	-26.98%	1.45%	-6.62%	0.04%
自基金合同生效起至今	127.36%	1.21%	102.16%	1.23%	25.20%	-0.02%

景顺长城大中华混合（QDII）C 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	0.34%	0.96%	2.77%	0.97%	-2.43%	-0.01%
过去三个月	8.14%	1.11%	9.64%	1.24%	-1.50%	-0.13%
过去六个月	2.39%	1.28%	11.59%	1.24%	-9.20%	0.04%
过去一年	-2.28%	1.22%	9.56%	1.21%	-11.84%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.50%	1.32%	30.09%	1.31%	-28.59%	0.01%

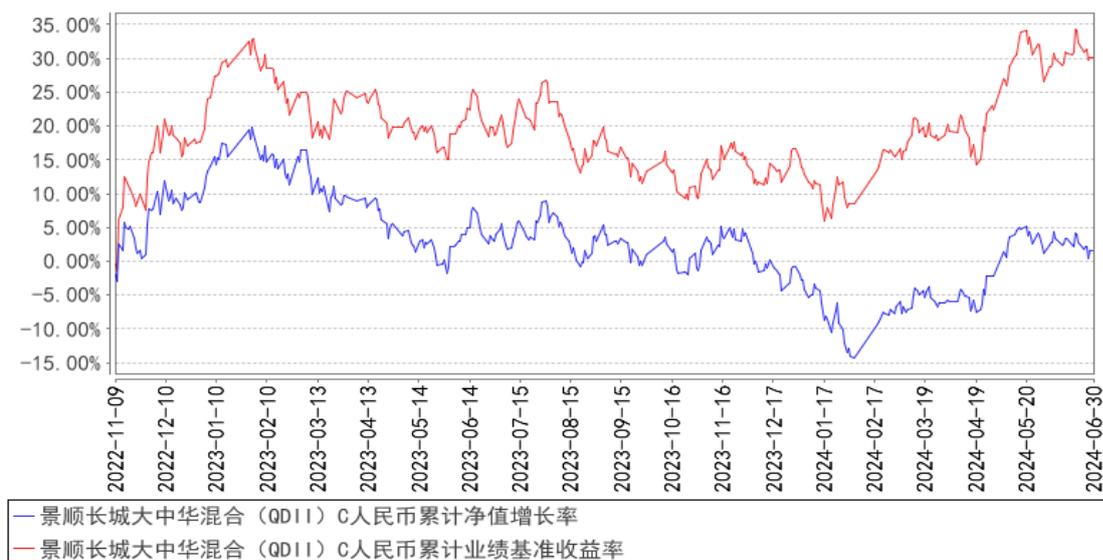
注：本基金自 2022 年 11 月 8 日起增设以人民币为单位进行销售和计价的 C 类基金份额，并于 2022 年 11 月 9 日开始对 C 类基金份额进行估值。

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

景顺长城大中华混合（QDII）A 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



景顺长城大中华混合（QDII）C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：本基金的资产配置比例为：股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的 60%，其中投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及其他证券市场交易的大中华企业的资产不低于基金股票及其他权益类资产的 80%；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%。本基金的建仓期为自 2011 年 9 月 22 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 2020 年 12 月 8 日起增设 A 类美元基金份额。本基金自 2022 年 11 月 8 日起增设以人民币为单位进行销售和计价的 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		
周寒颖	本基金的基金经理	2016年6月3日	-	18年	工商管理硕士。曾任招商基金研究部研究员、高级研究员、国际业务部高级研究员。2015年7月加入本公司，担任研究部高级研究员，自2016年6月起担任国际投资部基金经理。具有18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

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
马磊	首席投资总监 (中国内地和香港地区)	21	<p>马磊加盟景顺，担任中国内地和香港地区股票首席投资总监。马磊拥有20多年的经验，是一位经验丰富的中国内地和香港地区股票投资者。</p> <p>加盟景顺前，马磊曾为香港富达投资集团效力15年之久，担任首席中国主要投资组合经理。马磊成功管理并发展富达旗下的中国消费动力基金、大中华基金，以及台湾基金及强积金中港股票基金，截至2021年3月，其曾经管理的四项主要策略及七只基金资产规模逾140亿美元。</p> <p>马磊亦曾担任法国巴黎百富勤(BNP Paribas Peregrine)上海办事处的消费领域助理研究总监，以及担任复旦大学的助理教师。</p> <p>马磊亦是ESG投资的先锋。他曾创立了Green Renaissance Capital，专注于绿色能源投资及中国的碳净零战略。他亦曾是社会价值投资联盟(CASVI)的理事会成员及盟浪(Susallwave)的海外顾问，两者均是中国ESG评级及碳中和</p>

			业务的领先机构。 马磊持有复旦大学的法学学士学位及硕士学位。
--	--	--	-----------------------------------

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《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、《景顺长城大中华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。

4.4 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

回顾海内外的宏观经济，国内方面，一季度经济实现了较为强劲的开局之后，二季度经济边际有所走弱，多项经济指标放缓。5、6 两月 PMI 重新跌入收缩区间，基建投资逐月下滑，居民消费未能延续向上修复态势，货币增速大幅下滑，反映出经济企稳回升的过程遭遇波折。结构性亮点依然在出口，出口增速在全球制造业周期上行以及基数走低的背景下大幅好转，带动工业生产保持韧性，但是内需在地产持续下行、居民预期偏弱的背景下仍旧疲弱。二季度信贷投放大幅走弱，4、5 两月合计同比少增 3988 亿元，居民端和企业端双双疲弱。除了内生融资需求疲弱外，防止资金“沉淀空转”以及金融业增加值核算改革等因素都对信贷投放造成冲击。M1 和 M2 增速

也在二季度大幅下行，其中 5 月 M1 同比增速-4.2%，跌幅创历史新低。地产销售端和投资端的表现依旧疲弱，销售面积跌幅 20%以上，相比一季度跌幅有所加深，“517”地产新政对销售提振作用有限；投资端的跌幅逐月扩大，5 月累计同比下跌 10.1%，新开工和竣工的跌幅更深，累计同比分别下跌 24.2%和 20.1%。制造业投资延续了去年以及今年一季度的亮眼表现，4、5 两月投资增速保持在 9%以上的高增速，并且设备投资表现尤其突出，5 月增速上行至 18%。消费有所放缓，未能延续今年一季度向上修复的态势，二季度 4、5 两月社零平均增速 3%，相比一季度的 4.7%有明显的回落。

海外方面，美联储 6 月 FOMC 决议将基准利率维持在 5.25%-5.5%，点阵图将 2024 年降息次数从 3 次下调至 1 次。鲍威尔表示，虽然一季度美国 GDP 增速放缓，但个人实际消费以及私人部门投资显示内生增长动能仍然较强；就业方面，劳工市场的再平衡仍在持续，且一部分劳工指标已接近疫情前水平，工资增速仍然偏高，但已明显放缓，但整体看就业市场仍然较强；通胀方面，近期通胀有所放缓，5 月偏弱的 CPI 数据有助于增强对通胀回到 2%的信心。鲍威尔称，一季度通胀持续超预期使得联储推迟降息，虽然 5 月通胀数据超预期回落，但联储需更多数据以增强对通胀回到 2%的信心，未来降息路径仍是数据依赖。

2024 年上半年，纳斯达克指数上涨 18.13%，台湾加权指数上涨 28.45%，MSCI 金龙指数上涨 10.34%，恒生中国企业指数上涨 9.77%，恒生指数上涨 3.94%，恒生科技下跌 5.57%。二季度我们减仓了可选消费，从超配到平配。维持日常消费、电讯、原材料、工业、能源、医药超配。二季度基金净值上涨 8.23%，整体个股选择贡献正收益，低配公用事业和金融导致行业配置负贡献。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年上半年，景顺长城大中华混合基金 A 类份额净值增长率为 2.56%，业绩比较基准收益率为 11.59%。

2024 年上半年，景顺长城大中华混合基金 C 类份额净值增长率为 2.39%，业绩比较基准收益率为 11.59%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为国内经济环比二季度能够边际回升。发行进度明显落后的地方政府债有望提速，地方债项目落地有望带动银行配套信贷投放，设备更新和消费品以旧换新也有望在金融端获得更多支持，三季度信贷有望边际改善。“607”国常会提出“继续研究储备新的去库存、稳市场政策措施”，稳地产政策有望持续出台。国务院发布《推动大规模设备更新和消费品以旧换新行动方案》，对设备更新行动提出了更为具体的指导和量化目标，叠加预算内资金、5000 亿“科技创新和技术改造再贷款”以及财政贴息的支持，设备投资有望延续高增速。房价环比的加速下

行对居民资产负债表的冲击依旧持续抑制居民的消费意愿，但是三季度随着财政力度的边际扩大，有望带动经济边际回暖，从而带动居民就业和收入边际改善，叠加三季度进入暑期出游旺季，有望带动消费向上修复。通胀将会维持偏弱回升的态势。随着专项债的加速发行使用叠加超长期特别国债项目的落地，有望带动基建实物工作量提升，从而对 PPI 价格形成支撑，但是房地产维持弱势、结构性供需错配依旧对价格形成持续压制，价格偏弱的格局将会延续。

海外方面，从美国职位空缺率、离职率等前瞻性指标来看，劳动力市场边际降温将持续，工资增速也将边际放缓，但劳动力市场总体依旧健康，没有大幅走弱的风险。通胀在工资增速边际放缓以及租金价格滞后传导的带动下有望延续温和降温，但考虑到暑期出行旺季有可能对娱乐和出行分项带来边际提振，且美国进口价格指数以及美国核心商品温和回升，通胀环比走势仍可能有反复，或不足以支持联储在 9 月份降息，因此，预计 FOMC 在三季度会维持目前的利率水平。在劳动力市场边际放缓的背景下，居民消费或延续温和降温趋势，但薪资增速仍旧处于高位，6 月美国 CBO 最新预测今年美国财政力度再度扩张，财政再次发力对实体经济有额外支撑，美国国内实体需求仍将保持韧性。

大中华基金业绩基准是 MSCI 金龙指数，该指数具备跨市场特点，台湾市场占比 39.8%，港股占比 39%、美股占比 12.5%、中国 A 股占比 8.3%。由于契约限制大中华基金不能投资 A 股，只能投资海外。美股基准成分是中概股，纯美股作为非主题资产投资比例不超过基金资产 20%。该指数前五大行业是资讯科技、金融、可选消费、电讯、工业，占比分别是 36%、17.6%、16.6%、10%、4.3%。股票成分上，台积电是第一大个股权重，从一季度占指数 14%提高到 20%，而大中华基金即使配置 10%，仍然意味着低配，台积电二季度上涨 21.5%直接导致跑输指数，未来组合需要在美股和台股上增加资讯科技类标的，以降低最大权重股低配的影响。

从投资策略上，我们看重性价比，性价比是风险和收益的平衡，也是基本面和估值的结合。我们认为性价比可以用预期年回报率/风险来量化。预期年回报率包括业绩增长、估值变化、股息率、回购水平、实际利率等成分构成。而风险方面我们考虑多个层次的风险，公司层面的营运风险和财务风险，行业层面政策风险，宏观层面地缘政治风险，组合层面集中度和相关度等。通过性价比策略可用于行业内比较，也能够进行跨行业比较；可用于成长股比较，也能够价值股比较，也能够对成长和价值股放在同一维度比较。

按照这个策略我们投资三类股票类型：

一是低估值：估值偏低，但竞争力强的行业龙头公司。行业增速 5-10%左右，由于跨行业/冷门行业，容易被市场忽视的领域，公司竞争力强，长期成长路径清晰，增速 10-15%左右，估值偏低未来可能有提升空间增强回报。

二是高成长：市场大的主流趋势的回调阶段，公司在竞争中处于极为有利的战略位置的企业。新兴行业 20-30% 的高速增长，公司竞争地位极为有利，能够持续三年增速快于行业，由于业绩节奏/市场风格等因素导致回调，给与远期稳态低估值。

三是高分红及回购：供给有瓶颈，需求增长有预期差的行业，龙头公司能够通过分红和回购增强股东回报。随着经济增速下移，越来越多的行业进入稳定期，资本开支减少，企业价值分配上倾向于增加分红和回购来增强股东回报。

基于大中华基金的投资范围，三季度我们关注三个方向：基本面可能已经进入右侧的成长方向如美股半导体和美股消费电子；潜在受益于地产及经济复苏的方向的央企地产和消费；高股息尽管回调不大，但短期风险偏好回落，利率持续下行，会择机适度提高仓位。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

相关定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城大中华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	182,791,953.69	183,479,055.27
结算备付金		5,196,641.75	-
存出保证金		29,623.04	-
交易性金融资产	6.4.7.2	866,978,253.36	952,953,477.42
其中：股票投资		866,978,253.36	952,953,477.42
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		3,110,947.82	-
应收股利		3,688,847.03	535,734.83
应收申购款		191,183.03	1,040,315.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	6,471,495.00
资产总计		1,061,987,449.72	1,144,480,078.46
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		7,312,151.44	56,321,738.60
应付赎回款		3,897,939.45	1,897,089.24
应付管理人报酬		1,570,231.83	1,651,967.33
应付托管费		305,322.86	321,215.86
应付销售服务费		4,414.09	4,054.42
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	201,078.24	6,895,767.99
负债合计		13,291,137.91	67,091,833.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	594,715,372.36	626,951,795.37
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	453,980,939.45	450,436,449.65
净资产合计		1,048,696,311.81	1,077,388,245.02
负债和净资产总计		1,061,987,449.72	1,144,480,078.46

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 594,715,372.36 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.763 元，基金份额 582,967,865.43 份；本基金 A 类美元现汇份额净值美元 0.247 元，

基金份额 4,056,045.73 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.754 元，基金份额 7,691,461.20 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城大中华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		36,089,708.63	-50,972,021.86
1. 利息收入		101,185.78	124,217.05
其中：存款利息收入	6.4.7.13	101,185.78	124,217.05
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）		-27,316,954.08	15,078,445.64
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-34,179,509.71	-1,536,400.85
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	135,244.54
股利收益	6.4.7.20	6,862,555.63	16,479,601.95
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	65,609,572.71	-71,830,893.07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-2,335,924.43	5,546,503.06
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	31,828.65	109,705.46
减：二、营业总支出		11,085,776.15	14,333,785.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,115,168.07	11,816,363.85
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,772,393.83	2,297,626.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	24,214.17	14,412.09

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		-	488. 53
8. 其他费用	6. 4. 7. 24	174, 000. 08	204, 894. 30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25, 003, 932. 48	-65, 305, 806. 95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25, 003, 932. 48	-65, 305, 806. 95
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		25, 003, 932. 48	-65, 305, 806. 95

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城大中华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	626, 951, 795. 37	-	450, 436, 449. 65	1, 077, 388, 245. 02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	626, 951, 795. 37	-	450, 436, 449. 65	1, 077, 388, 245. 02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-32, 236, 423. 01	-	3, 544, 489. 80	-28, 691, 933. 21
（一）、综合收益总额	-	-	25, 003, 932. 48	25, 003, 932. 48
（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）	-32, 236, 423. 01	-	-21, 459, 442. 68	-53, 695, 865. 69
其中：1. 基金申	15, 940, 911. 98	-	10, 659, 862. 84	26, 600, 774. 82

购款				
2. 基金赎回款	-48,177,334.99	-	-32,119,305.52	-80,296,640.51
(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	594,715,372.36	-	453,980,939.45	1,048,696,311.81
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	661,976,412.72	-	582,214,102.20	1,244,190,514.92
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	661,976,412.72	-	582,214,102.20	1,244,190,514.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	38,572,288.00	-	-24,112,530.97	14,459,757.03
(一)、综合收益总额	-	-	-65,305,806.95	-65,305,806.95
(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）	38,572,288.00	-	41,193,275.98	79,765,563.98
其中：1. 基金申购款	108,541,759.78	-	102,505,948.15	211,047,707.93
2. 基金赎回款	-69,969,471.78	-	-61,312,672.17	-131,282,143.95
(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	700,548,700.72	-	558,101,571.23	1,258,650,271.95

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

景顺长城大中华混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 709 号《关于核准景顺长城大中华股票型证券投资基金募集的批复》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《景顺长城大中华股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 291,060,560.03 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 367 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城大中华股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 291,092,562.55 份基金份额,其中认购资金利息折合 32,002.52 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司,境外资产托管人为渣打银行(香港)有限公司(StandardCharteredBank(HongKong)Limited)。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,景顺长城大中华股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 5 日公告后更名为景顺长城大中华混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为股票及其他权益类证券、现金、债券、股指期货及中国证监会允许投资的其它金融工具。本基金对于股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的 60%,其中投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及在其他证券市场交易的大中华企业的资产不低于基金股票及其他权益类资产的 80%;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：摩根斯坦利金龙净总收益指数 (MSCIGoldenDragonNetTotalReturnIndex)。

根据本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2020 年 12 月 8 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城大中华混合型证券投资基金增设美元基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告》和更新后的《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》，自 2020 年 12 月 8 日起，本基金根据申购、赎回所使用货币的不同，在现有人民币基金份额的基础上增设美元基金份额，原有基金份额将自动划归为本基金人民币基金份额。本基金以人民币计价并进行申购、赎回的份额类别，称为人民币基金份额；以美元计价并进行申购、赎回的份额类别，称为美元基金份额。本基金对人民币基金份额和美元基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值和基金份额累计净值。人民币基金份额和美元基金份额合并投资运作，共同承担投资换汇产生的费用及其他相关费用。投资者在申购基金份额时可自行选择基金份额类别，并交付相应币种的款项。

根据本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2022 年 11 月 8 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城大中华混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告》，自 2022 年 11 月 8 日起，本基金在现有基金份额的基础上增设以人民币为单位进行销售和计价的 C 类基金份额，原人民币基金份额(基金代码：262001)转为 A 类人民币基金份额、原美元基金份额(基金代码：010671)转为 A 类美元基金份额。根据更新后的《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，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 类基金份额包括 A 类人民币基金份额和 A 类美元现汇基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额，C 类基金份额仅设 C 类人民币基金份额。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。投资者可自行选择申购的基金份额类别。

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	182,791,953.69
等于：本金	182,785,517.25
加：应计利息	6,436.44
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	182,791,953.69

注：于 2024 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 63,004,432.66 元(折合人民币 57,502,885.60 元)，美元 1,145,874.28 元(折合人民币 8,166,416.82 元)，新台币 236,857,819.00

元(折合人民币 52,037,310.17 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	727,015,444.89	-	866,978,253.36	139,962,808.47
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	727,015,444.89	-	866,978,253.36	139,962,808.47

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	6,635.91
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	62,351.81
其中：交易所市场	62,351.81
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	132,090.52
合计	201,078.24

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城大中华混合（QDII）A 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	619,862,626.48	619,862,626.48
本期申购	14,330,022.34	14,330,022.34
本期赎回（以“-”号填列）	-47,168,737.66	-47,168,737.66
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	587,023,911.16	587,023,911.16

景顺长城大中华混合（QDII）C 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	7,089,168.89	7,089,168.89
本期申购	1,610,889.64	1,610,889.64
本期赎回（以“-”号填列）	-1,008,597.33	-1,008,597.33
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	7,691,461.20	7,691,461.20

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

景顺长城大中华混合（QDII）A 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	-167,306,045.19	612,688,241.63	445,382,196.44
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-167,306,045.19	612,688,241.63	445,382,196.44
本期利润	-40,108,803.56	64,775,558.89	24,666,755.33
本期基金份额交易产生的变动数	10,248,693.72	-32,117,906.31	-21,869,212.59
其中：基金申购款	-4,501,698.32	14,054,310.25	9,552,611.93
基金赎回款	14,750,392.04	-46,172,216.56	-31,421,824.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-197,166,155.03	645,345,894.21	448,179,739.18

景顺长城大中华混合（QDII）C 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	-1,966,520.54	7,020,773.75	5,054,253.21
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	-1,966,520.54	7,020,773.75	5,054,253.21
本期利润	-496,836.67	834,013.82	337,177.15
本期基金份额交易产生的变动数	-201,070.32	610,840.23	409,769.91
其中：基金申购款	-536,036.76	1,643,287.67	1,107,250.91
基金赎回款	334,966.44	-1,032,447.44	-697,481.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,664,427.53	8,465,627.80	5,801,200.27

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		91,081.80
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		9,933.95
其他		170.03
合计		101,185.78

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		-34,179,509.71
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		-34,179,509.71

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		537,883,025.59
减：卖出股票成本总额		570,120,492.96
减：交易费用		1,942,042.34
买卖股票差价收入		-34,179,509.71

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

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,862,555.63
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	6,862,555.63

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	65,609,572.71
股票投资	65,609,572.71
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	65,609,572.71

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	31,828.65
合计	31,828.65

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	54,700.10
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	364.00
其他	35,122.77
税务代理费	17,663.99
证券组合费	6,476.88
合计	174,000.08

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
渣打银行（香港）有限公司（“渣打银行（香港）”）	境外资产托管人
景顺长城资产管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
长城证券	1,432,052.16	0.15	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
长城证券	1,145.62	0.12	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
长城证券	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手

费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,115,168.07	11,816,363.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,181,815.89	2,625,079.52
应支付基金管理人的净管理费	6,933,352.18	9,191,284.33

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.80%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.80\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,772,393.83	2,297,626.32

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.35\% / \text{当年天数}。$$

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		
	景顺长城大中华混合（QDII）A人民币	景顺长城大中华混合（QDII）C人民币	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	434.56	434.56
中国工商银行	-	6.82	6.82
长城证券	-	-	-
合计	-	441.38	441.38

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城大中华混合 (QDII) A 人民币	景顺长城大中华混合 (QDII) C 人民币	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	346.24	346.24
中国工商银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	346.24	346.24

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 X 0.40% / 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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

景顺长城大中华混合（QDII）A 人民币

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例 (%)
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	6,258,606.65	1.07	6,258,606.65	1.01

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的总份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
渣打银行（香港）-活期	110,430,886.35	3,022.91	179,583,096.78	7,685.33
中国工商银行-活期	72,361,067.34	88,058.89	69,590,539.07	101,869.87

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

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	129,857,187.69	-	-	-	-	52,934,766.00	182,791,953.69
结算备付金	5,196,641.75	-	-	-	-	-	5,196,641.75
存出保证金	29,623.04	-	-	-	-	-	29,623.04
交易性金融资产	-	-	-	-	-	866,978,253.36	866,978,253.36
应收股利	-	-	-	-	-	3,688,847.03	3,688,847.03
应收申购款	2,271.36	-	-	-	-	188,911.67	191,183.03
应收清算款	-	-	-	-	-	3,110,947.82	3,110,947.82
资产总计	135,085,723.84	-	-	-	-	926,901,725.88	1,061,987,449.72
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,897,939.45	3,897,939.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,570,231.83	1,570,231.83
应付托管费	-	-	-	-	-	305,322.86	305,322.86
应付清算款	-	-	-	-	-	7,312,151.44	7,312,151.44
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,414.09	4,414.09
其他负债	-	-	-	-	-	201,078.24	201,078.24
负债总计	-	-	-	-	-	13,291,137.91	13,291,137.91
利率敏感度缺口	135,085,723.84	-	-	-	-	-	-
上年度末	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

2023 年 12 月 31 日		月	年	年	上		
资产							
货币资金	157,349,132.51	-	-	-	-	26,129,922.76	183,479,055.27
交易性金融资产	-	-	-	-	-	952,953,477.42	952,953,477.42
应收股利	-	-	-	-	-	535,734.83	535,734.83
应收申购款	8,822.46	-	-	-	-	1,031,493.48	1,040,315.94
其他资产	-	-	-	-	-	6,471,495.00	6,471,495.00
资产总计	157,357,954.97	-	-	-	-	987,122,123.49	1,144,480,078.46
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,897,089.24	1,897,089.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,651,967.33	1,651,967.33
应付托管费	-	-	-	-	-	321,215.86	321,215.86
应付清算款	-	-	-	-	-	56,321,738.60	56,321,738.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,054.42	4,054.42
其他负债	-	-	-	-	-	6,895,767.99	6,895,767.99
负债总计	-	-	-	-	-	67,091,833.44	67,091,833.44
利率敏感度缺口	157,357,954.97	-	-	-	-	-	-

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	8,166,416.82	57,502,885.60	52,037,310.17	117,706,612.59
交易性金融资产	62,270,235.90	666,457,896.01	138,250,121.45	866,978,253.36

应收股利	164,496.88	2,025,170.76	351,530.02	2,541,197.66
应收申购款	2,846.16	-	-	2,846.16
资产合计	70,603,995.76	725,985,952.37	190,638,961.64	987,228,909.77
以外币计价的负债				
应付清算款	-	7,312,151.44	-	7,312,151.44
应付赎回款	598,890.52	-	-	598,890.52
其他负债	19,397.65	-	-	19,397.65
负债合计	618,288.17	7,312,151.44	-	7,930,439.61
资产负债表外汇风险敞口净额	69,985,707.59	718,673,800.93	190,638,961.64	979,298,470.16
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	7,758,324.91	52,733,219.66	25,238,020.31	85,729,564.88
交易性金融资产	133,893,849.51	703,146,732.51	115,912,895.40	952,953,477.42
应收股利	-	175,702.79	360,032.04	535,734.83
应收申购款	2,922.11	-	-	2,922.11
其他资产	6,471,495.00	-	-	6,471,495.00
资产合计	148,126,591.53	756,055,654.96	141,510,947.75	1,045,693,194.24
以外币计价的负债				
应付清算款	6,471,495.00	39,092,859.65	-	45,564,354.65
应付赎回款	1,698.36	-	-	1,698.36
其他负债	6.45	6,472,768.64	-	6,472,775.09
负债合计	6,473,199.81	45,565,628.29	-	52,038,828.10
资产负债表外汇风险敞口净额	141,653,391.72	710,490,026.67	141,510,947.75	993,654,366.14

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%	48,964,923.51	49,682,718.31
	所有外币相对人民币贬值 5%	-48,964,923.51	-49,682,718.31

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	866,978,253.36	82.67	952,953,477.42	88.45
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	866,978,253.36	82.67	952,953,477.42	88.45

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%	29,078,243.99	37,348,405.61
	沪深 300 指数下降 5%	-29,078,243.99	-37,348,405.61

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	866,978,253.36	952,953,477.42
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	866,978,253.36	952,953,477.42

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	866,978,253.36	81.64
	其中：普通股	806,271,011.43	75.92
	存托凭证	60,707,241.93	5.72
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	187,988,595.44	17.70
8	其他各项资产	7,020,600.92	0.66
9	合计	1,061,987,449.72	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 106,892,032.02 元，占基金资产净值比例为 10.19%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	666,457,896.01	63.55
中国台湾	138,250,121.45	13.18
美国	62,270,235.90	5.94
合计	866,978,253.36	82.67

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
原材料	99,994,370.78	9.54
周期性消费品	59,780,156.67	5.70
非周期性消费品	175,052,580.73	16.69

综合	-	-
能源	33,288,433.19	3.17
金融	-	-
基金	-	-
工业	128,799,748.09	12.28
信息技术	122,127,904.24	11.65
公用事业	-	-
通讯	247,935,059.66	23.64
合计	866,978,253.36	82.67

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例 (%)
1	TAIWAN SEMICONDU CTOR MANUFACTU RING	台积电	2330 TT	台湾证 券交易 所	中国 台湾	470,000	99,747,517.99	9.51
2	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控 股	700 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	288,400	98,021,978.03	9.35
3	GIANT BIOGENE HOLDING	巨子生 物	2367 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	1,325,000	55,446,450.85	5.29
4	New Oriental Education & Technolog y	新东方 教育科 技集团	9901 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	949,000	51,708,159.20	4.93
5	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	紫金矿 业	2899 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	3,358,000	50,507,565.17	4.82
6	CHINA MOBILE LTD	中国移 动	941 HK	深港通 联合市 场	中国 香港	715,000	50,247,597.40	4.79
7	Morimatsu Internati	森松国 际	2155 HK	香港联 合交易	中国 香港	9,457,000	44,882,316.75	4.28

	onal Holding			所				
8	PINDUODUO INC-ADR	拼多多	PDD US	纳斯达克证券交易所	美国	43,838	41,536,858.33	3.96
9	HUTCHISON WHAMPOA LTD	和黄医药	13 HK	香港联合交易所	中国香港	1,519,500	38,137,474.65	3.64
10	Haier Smart Home Co Ltd	海尔智家	6690 HK	香港联合交易所	中国香港	1,496,000	35,636,138.20	3.40
11	HON HAI PRECISION INDUSTRY	鸿海精密工业股份有限公司	2317 TT	台湾证券交易所	中国台湾	638,000	29,995,877.11	2.86
12	Cowell e Holdings Inc	高伟电子	1415 HK	香港联合交易所	中国香港	1,322,000	29,621,120.67	2.82
13	XIAOMI CORP-CLASS B	小米集团	1810 HK	香港联合交易所	中国香港	1,924,000	28,938,819.35	2.76
14	CMOC GROUP LTD-H	洛阳钼业	3993 HK	香港联合交易所	中国香港	3,861,000	25,160,342.41	2.40
15	SINO BIOPHARMA CEUTICAL	中国生物制药	1177 HK	香港联合交易所	中国香港	9,318,000	22,706,620.48	2.17
16	Yadea Group Holdings LTD	雅迪控股	01585 HS	深港通联合市场	中国香港	2,354,000	21,205,188.87	2.02
17	CNOOC LTD	中国海洋石油	883 HK	香港联合交易所	中国香港	1,020,000	20,852,912.64	1.99
18	CSSC Offshore and Marine Engineering company LTD	中船防务	317 HK	香港联合交易所	中国香港	1,270,000	20,400,223.36	1.95
19	ZHAOJIN MINING INDUSTRY	招金矿业	1818 HK	香港联合交易所	中国香港	1,651,000	19,739,534.31	1.88
20	Tencent	腾讯音	TME US	纽约证	美国	191,452	19,170,383.60	1.83

	Music Entertainment	乐		券交易所				
21	China Coal Energy Co Ltd	中煤能源	1898 HK	香港联合交易所	中国香港	1,494,000	12,435,520.55	1.19
22	LENOVO GROUP LTD	联想集团	992 HK	香港联合交易所	中国香港	1,224,000	12,310,665.93	1.17
23	ASPEED Technology Inc	信骅	5274 TT	台湾证券交易所	中国台湾	8,000	8,506,726.35	0.81
24	Gushengta ng Holdings Ltd	固生堂	2273 HK	香港联合交易所	中国香港	206,100	7,053,875.55	0.67
25	China Nonferrous Mining Corporation LTD	中国有色矿业	01258 HS	深港通联合市场	中国香港	738,000	4,586,928.89	0.44
26	Meitu Inc	美图公司	1357 HK	香港联合交易所	中国香港	1,729,500	4,167,187.36	0.40
27	Chervon Holdings Ltd	泉峰控股	2285 HK	香港联合交易所	中国香港	234,800	3,900,210.20	0.37
28	MAOYAN ENTERTAINMENT	猫眼娱乐	1896 HK	香港联合交易所	中国香港	407,800	2,996,136.78	0.29
29	Laopu Gold Co. Ltd	老铺黄金	6181 HK	香港联合交易所	中国香港	46,000	2,938,829.60	0.28
30	Bilibili Inc	哔哩哔哩	9626 HK	香港联合交易所	中国香港	24,660	2,856,098.81	0.27
31	Duolingo Inc	多邻国	DUOL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,051	1,562,993.97	0.15

注：本基金对以上证券代码采用彭博代码即 BB Ticker。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	762 HK	39,833,187.01	3.70
2	China Coal Energy Co Ltd	1898 HK	34,004,683.87	3.16
3	Li Auto Inc	LI US	17,913,619.75	1.66
3	Li Auto Inc	2015 HK	15,333,002.25	1.42
4	Haier Smart Home Co Ltd	6690 HK	29,806,342.25	2.77
5	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	28,877,838.49	2.68
6	CMOC GROUP LTD-H	3993 HK	23,507,875.99	2.18
7	HON HAI PRECISION INDUSTRY	2317 TT	22,000,781.56	2.04
8	CNOOC LTD	883 HK	21,718,168.16	2.02
9	CHINA MOBILE LTD	941 HK	21,349,964.68	1.98
10	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	2899 HK	19,537,810.72	1.81
11	Cowell e Holdings Inc	1415 HK	18,152,033.03	1.68
12	HUTCHISON WHAMPOA LTD	13 HK	15,960,101.72	1.48
13	ZHAOJIN MINING INDUSTRY	1818 HK	15,164,259.16	1.41
14	GIANT BIOGENE HOLDING	2367 HK	10,716,581.91	0.99
15	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	10,094,897.03	0.94
16	New Oriental Education & Technology	9901 HK	9,981,349.52	0.93
17	LENOVO GROUP LTD	992 HK	8,992,023.40	0.83
18	PINDUODUO INC-ADR	PDD US	7,726,583.68	0.72
19	Meitu Inc	1357 HK	6,389,103.01	0.59
20	MAOYAN ENTERTAINMENT	1896 HK	6,204,616.16	0.58

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	PINDUODUO INC-ADR	PDD US	57,322,784.03	5.32
2	Li Auto Inc	2015 HK	38,425,326.05	3.57

2	Li Auto Inc	LI US	10,960,242.55	1.02
3	LENOVO GROUP LTD	992 HK	47,009,326.23	4.36
4	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	762 HK	40,301,920.13	3.74
5	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	268 HK	37,210,509.86	3.45
6	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2330 TT	32,509,921.41	3.02
7	China Coal Energy Co Ltd	1898 HK	31,022,538.08	2.88
8	WuXi AppTec Co Ltd	2359 HK	27,276,947.83	2.53
9	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	285 HK	25,940,600.30	2.41
10	Yadea Group Holdings LTD	01585 HS	24,105,589.19	2.24
11	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	EDU US	11,544,065.69	1.07
11	New Oriental Education & Technology	9901 HK	6,886,023.44	0.64
12	MEDIATEK INC	2454 TT	16,001,232.50	1.49
13	KUAISHOU-W	1024 HK	13,478,957.07	1.25
14	Tencent Music Entertainment	TME US	12,692,743.02	1.18
15	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	10,777,839.24	1.00
16	Cowell e Holdings Inc	1415 HK	9,282,517.35	0.86
17	Kingboard Laminates Holdings	1888 HK	8,626,846.94	0.80
18	BeiGene Ltd	6160 HK	8,575,805.28	0.80
19	Haier Smart Home Co Ltd	6690 HK	8,555,652.29	0.79
20	3sbio Inc	01530 HS	8,520,321.54	0.79

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	418,535,696.19
卖出收入（成交）总额	537,883,025.59

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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

本基金本报告期末未持有基金投资。

7.11 投资组合报告附注

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

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

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	29,623.04
2	应收清算款	3,110,947.82
3	应收股利	3,688,847.03
4	应收利息	-
5	应收申购款	191,183.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,020,600.92

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
景顺长城大中华混合（QDII）A 人民币	84,418	6,953.78	251,073,149.77	42.77	335,950,761.39	57.23
景顺长城大中华混合（QDII）C 人民币	656	11,724.79	5,022,638.76	65.30	2,668,822.44	34.70
合计	85,074	6,990.57	256,095,788.53	43.06	338,619,583.83	56.94

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	景顺长城大中华混合（QDII）A 人民币	583,751.24	0.099442
	景顺长城大中华混合（QDII）C 人民币	105,956.93	1.377592
	合计	689,708.17	0.115973

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	景顺长城大中华混合（QDII）A 人民币	10~50
	景顺长城大中华混合（QDII）C 人民币	-
	合计	10~50

本基金基金经理持有本 开放式基金	景顺长城大中华混合（QDII） A 人民币	0~10
	景顺长城大中华混合（QDII） C 人民币	10~50
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城大中华混合（QDII）A 人民币	景顺长城大中华混合（QDII）C 人民币
基金合同生效日 （2011年9月22日） 基金份额总额	291,092,562.55	-
本报告期期初基金份 额总额	619,862,626.48	7,089,168.89
本报告期基金总申购 份额	14,330,022.34	1,610,889.64
减：本报告期基金总 赎回份额	47,168,737.66	1,008,597.33
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	587,023,911.16	7,691,461.20

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

本基金本报告期末未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
China International Capital Corporation Limited	1	163,782,124.18	17.12	136,803.03	14.65	-
Haitong International Securities Company Limited	1	153,337,541.49	16.03	115,563.81	12.38	-
J.P. MORGAN Securities (Asia Pacific) Limited	1	108,111,934.92	11.3	162,167.92	17.37	-
CLSA Limited	1	71,064,144.46	7.43	68,525.25	7.34	-
国投证券	1	66,327,304.38	6.93	53,061.49	5.68	-

股份有限 公司						
Citigroup Global Markets Asia Limited	1	63,352,973.48	6.62	63,352.97	6.79	-
UBS Securitie s Asia Limited	1	54,923,032.21	5.74	54,923.03	5.88	-
开源证券 股份有限 公司	2	46,873,912.06	4.9	37,499.31	4.02	-
Yuanta Securitie s Co., Ltd.	1	46,291,118.39	4.84	69,436.46	7.44	-
国海证券 股份有限 公司	1	38,038,047.42	3.98	30,430.39	3.26	-
天风证券 股份有限 公司	1	33,600,449.02	3.51	26,879.71	2.88	-
中信证券 股份有限 公司	3	29,334,203.86	3.07	23,466.82	2.51	-
MASTERLIN K	1	26,687,366.91	2.79	32,024.45	3.43	-
中泰证券 股份有限 公司	1	18,986,628.36	1.99	15,189.44	1.63	-
瑞银证券 有限责任 公司	1	10,710,877.02	1.12	8,568.54	0.92	-
方正证券 股份有限 公司	2	8,555,652.29	0.89	6,844.00	0.73	-
华创证券 有限责任 公司	1	5,202,099.73	0.54	4,161.77	0.45	-
海通证券 股份有限 公司	1	4,992,920.51	0.52	3,994.48	0.43	-

兴业证券股份有限公司	1	3,114,630.88	0.33	2,491.63	0.27	-
China Securities (International) Brokerage Company Limited	1	1,699,708.05	0.18	16,997.08	1.82	本期新增
长城证券股份有限公司	1	1,432,052.16	0.15	1,145.62	0.12	-
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份有限	1	-	-	-	-	-

公司						
国盛证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华西证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
瑞信证券 （中国）有 限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中航证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

证券股份 有限公司						
中邮证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
China Renaissan ce	1	-	-	-	-	-
ICBC Internati onal Holdings Limited	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回 购交易		权证交 易		基金交 易	
	成交 金额	占 当 期 债 券 成 交	成交 金额	占 当 期 债 券 回 购	成交 金额	占 当 期 权 证 成 交	成交 金额	占 当 期 基 金 成 交

		总 额 的 比 例 (%)		成 交 总 额 的 比 例 (%)		总 额 的 比 例 (%)		总 额 的 比 例 (%)
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
J.P. MORGAN Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
Yuanta Securities Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
MASTERLINK	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
China Securities (International) Brokerage Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞信证券（中国）有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
China Renaissance	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBC International Holdings Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于景顺长城大中华混合型证券投资基金 2024 年境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）和赎回业务安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 4 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
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	景顺长城大中华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
6	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 2 月 2 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报刊及	2024 年 2 月 23 日

	部分基金新增微众银行为销售机构的公告	网站	
8	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 2 月 26 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 22 日
10	关于警惕假冒景顺长城基金 APP 开展诈骗活动的声明	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 27 日
11	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 28 日
12	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
13	景顺长城大中华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
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 13 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 15 日
16	景顺长城大中华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
17	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
18	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 13 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 24 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 31 日
21	景顺长城大中华混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 14 日
22	景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 21 日
23	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）和赎回业务安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 27 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240117-20240630	124,518,606.86	0.00	0.00	124,518,606.86	20.94

产品特有风险

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

1、大额申购风险

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

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

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

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

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

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

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

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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城大中华股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《景顺长城大中华混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城大中华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