

景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 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 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	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	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
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合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21

§ 8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	84
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	84
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	85
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	85
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	85
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	85
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	85
8.12 投资组合报告附注	85
§ 9 基金份额持有人信息	86
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	86
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	86
9.3 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	86
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	87
§ 10 开放式基金份额变动	87
§ 11 重大事件揭示	87
11.1 基金份额持有人大会决议	87
11.2 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	87
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	87
11.4 基金投资策略的改变	87
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	87
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	88
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	88
11.8 其他重大事件	91
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	94
12.1 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	94
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	95
§ 13 备查文件目录	95
13.1 备查文件目录	95
13.2 存放地点	95
13.3 查阅方式	95

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城量化小盘股票
场内简称	无
基金主代码	005457
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月6日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,086,722,403.05份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型精选股票，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略： 本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略： 本基金主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。</p> <p>3、债券投资策略： 出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
		王小飞
		021-60637103
		wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	4008888606	021-60637228
传真	0755-22381339	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	李进	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-97,495,803.07	-153,152,782.37	60,724,703.83
本期利润	-91,089,041.74	-192,848,570.78	72,670,568.84
加权平均基金份额本期利润	-0.1061	-0.3963	0.3689
本期加权平均净值利润率	-7.61%	-24.56%	21.90%
本期基金份额净值增长率	-2.90%	-17.50%	31.98%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	223,668,980.97	172,774,137.11	319,030,729.85
期末可供分配基金份额利润	0.2058	0.5149	0.8363
期末基金资产净值	1,310,391,384.02	508,350,941.26	700,511,812.78
期末基金份额净值	1.2058	1.5148	1.8362
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	47.09%	51.48%	83.62%

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

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

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

金资产。

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

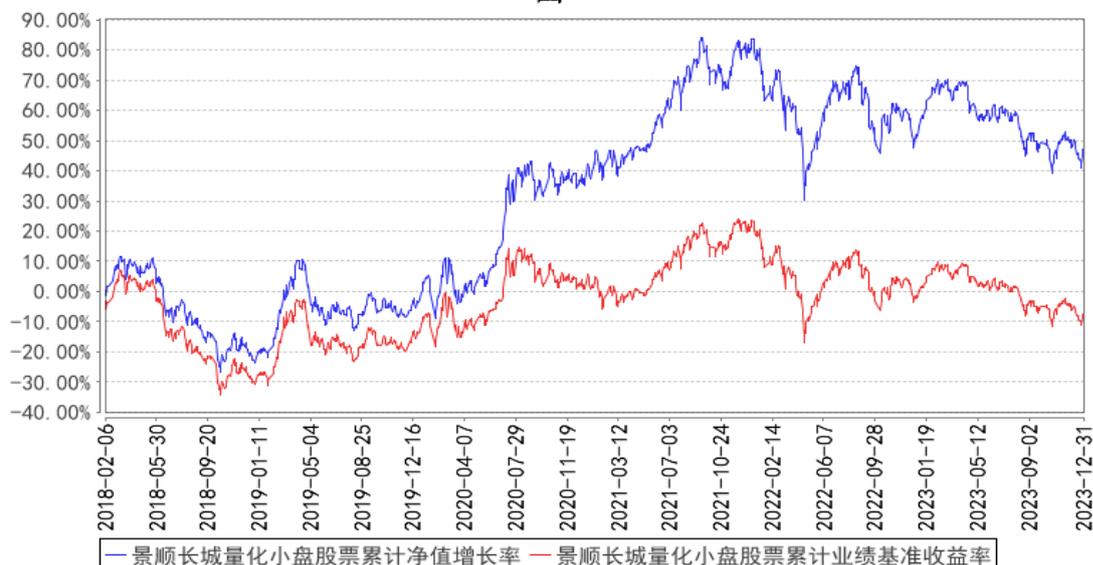
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.67%	0.96%	-2.98%	0.98%	1.31%	-0.02%
过去六个月	-8.37%	0.94%	-10.28%	0.95%	1.91%	-0.01%
过去一年	-2.90%	0.89%	-5.91%	0.90%	3.01%	-0.01%
过去三年	5.72%	1.17%	-10.58%	1.21%	16.30%	-0.04%
过去五年	90.18%	1.34%	31.93%	1.37%	58.25%	-0.03%
自基金合同生效起至今	47.09%	1.37%	-7.69%	1.39%	54.78%	-0.02%

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

景顺长城量化小盘股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

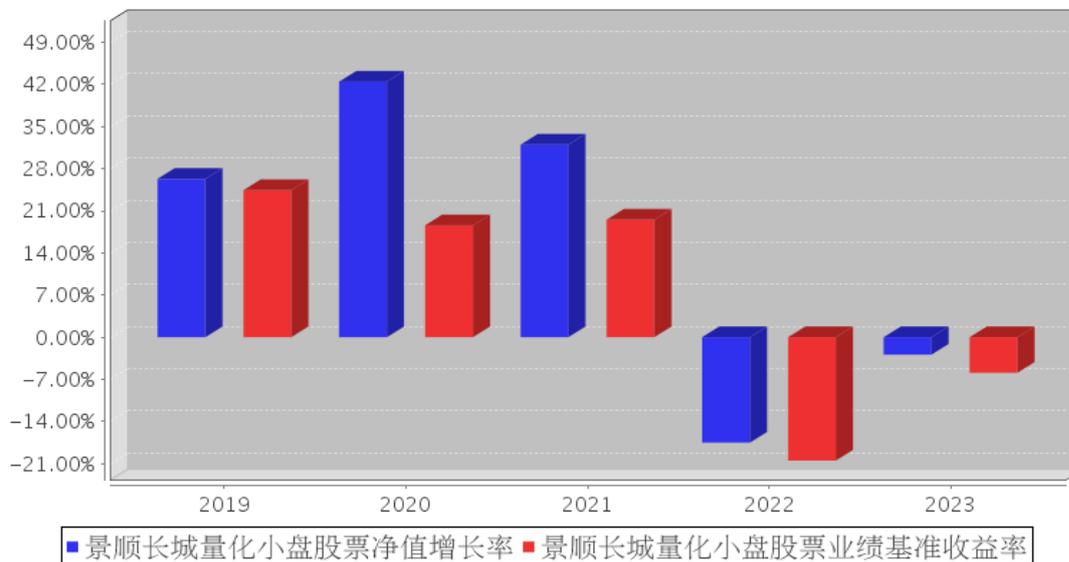


注：基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 80%–95%，投资于小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%–20%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的建仓期为自 2018 年 2 月 6 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投

投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城量化小盘股票基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	2.8000	261,448,879.02	44,756,772.20	306,205,651.22	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	2.8000	261,448,879.02	44,756,772.20	306,205,651.22	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2023 年 12 月 31 日，本公司旗下共管理 179 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		
黎海威	本基金的基金经理	2018 年 2 月 6 日	-	20 年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有 20 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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日

的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 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投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 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 31 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年是三年新冠疫情防控转折后经济恢复发展的一年，但受制于地产持续调整、外需走弱、社会预期偏弱等不利因素，修复过程较为波折。2023 年全年 GDP 增长 5.2%，高于年初制定的 5% 左右的增长目标。12 月 PMI 指数为 49，经济景气程度依旧偏弱。12 月 PPI 同比下跌 2.7%，环比下跌 0.3%；12 月 CPI 同比下跌 0.30%，环比上涨 0.10%，价格信号依旧偏弱。12 月 M2 同比增速为 9.7%，M1 同比增速为 1.3%，全年社会融资规模同比增长 9.84%。12 月末外汇储备 3.2 万亿美元，汇率整体平稳。2023 年全年 A 股市场表现疲软，风格方面小盘优于大盘、价值优于成长，沪深 300、中证 500 和创业板指分别下跌 11.38%、7.42% 和 19.41%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年度，本基金份额净值增长率为-2.90%，业绩比较基准收益率为-5.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，海外方面，美国经济预计保持相当韧性，在通胀得到控制之后，联储有望开启

宽松周期，这将有利于新兴市场的资产表现；国内方面，有效需求不足以及地产行业的调整等因素将会导致经济回升面临一定的困难，但中央财政的持续发力以及“三大工程”有望对经济形成一定支撑，而中美库存周期的震荡回升有望对全年经济形成拉动。市场风格方面，过去 2 年成长与价值、大盘与小盘的分化有望得到改善，市场风格将更加均衡。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。我们的投资组合仍然会维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生成长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生长期投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做

出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

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。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，

由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施了二次利润分配。(1)截至 2023 年 6 月 21 日,本基金可供分配利润为 648,751,607.99 元,本基金的基金管理人已于 2023 年 6 月 28 日完成权益登记,每 10 份基金份额派发红利 2.38 元,详细信息请查阅相关分红公告。(2)截至 2023 年 12 月 25 日,本基金可供分配利润为 233,332,397.90 元,本基金的基金管理人已于 2023 年 12 月 28 日完成权益登记,每 10 份基金份额派发红利 0.42 元,详细信息请查阅相关分红公告。

截至本报告期末,根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况,经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 25180 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城量化小盘股票型证券投资基金(以下简称“景顺长城量化小盘基金”)的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了景顺长城量化小盘基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于景顺长城量化小盘基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>景顺长城量化小盘基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估景顺长城量化小盘基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算景顺长城量化小盘基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督景顺长城量化小盘基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、</p>

	<p>适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对景顺长城量化小盘基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城量化小盘基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	朱宏宇 郭劲扬
会计师事务所的地址	中国上海市
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	85,365,489.72	29,280,457.86
结算备付金		31,032,622.31	2,485,449.52
存出保证金		4,224,180.16	316,290.19
交易性金融资产	7.4.7.2	1,205,831,923.67	479,660,016.70
其中：股票投资		1,204,657,343.66	479,660,016.70
基金投资		-	-
债券投资		1,174,580.01	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	3,765,276.40
应收股利		-	-
应收申购款		86,042.14	166,612.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,326,540,258.00	515,674,103.60
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		9,787,675.00	2,989,206.15
应付赎回款		245,958.94	1,106,948.22
应付管理人报酬		1,391,377.54	702,986.93
应付托管费		231,896.27	117,164.47
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.78	3.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	4,491,963.45	2,406,853.52
负债合计		16,148,873.98	7,323,162.34
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	1,086,722,403.05	335,576,804.15
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	223,668,980.97	172,774,137.11
净资产合计		1,310,391,384.02	508,350,941.26
负债和净资产总计		1,326,540,258.00	515,674,103.60

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2058 元，基金份额总额 1,086,722,403.05 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-71,829,345.70	-178,922,465.20
1. 利息收入		753,237.54	283,880.59
其中：存款利息收入	7.4.7.13	753,237.54	283,880.59
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）		-79,483,102.73	-141,586,005.11
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-93,253,478.78	-151,352,807.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	1,730,006.34	671,500.16
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-4,618,098.49	-
股利收益	7.4.7.19	16,658,468.20	9,095,302.64
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）	7.4.7.20	6,406,761.33	-39,695,788.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	493,758.16	2,075,447.73
减：二、营业总支出		19,259,696.04	13,926,105.58
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	16,322,969.98	11,774,996.71
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,720,494.95	1,962,499.45
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		100.19	2.60
8. 其他费用	7.4.7.23	216,130.92	188,606.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-91,089,041.74	-192,848,570.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-91,089,041.74	-192,848,570.78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-91,089,041.74	-192,848,570.78

7.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	335,576,804.15	-	172,774,137.11	508,350,941.26
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	335,576,804.15	-	172,774,137.11	508,350,941.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	751,145,598.90	-	50,894,843.86	802,040,442.76
（一）、综合收益总额	-	-	-91,089,041.74	-91,089,041.74
（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）	751,145,598.90	-	448,189,536.82	1,199,335,135.72
其中：1. 基金申购款	937,425,732.34	-	533,867,808.26	1,471,293,540.60
2. 基金赎回款	-186,280,133.44	-	-85,678,271.44	-271,958,404.88
（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）	-	-	-306,205,651.22	-306,205,651.22

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,086,722,403.05	-	223,668,980.97	1,310,391,384.02
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	381,481,082.93	-	319,030,729.85	700,511,812.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	381,481,082.93	-	319,030,729.85	700,511,812.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-45,904,278.78	-	-146,256,592.74	-192,160,871.52
（一）、综合收益总额	-	-	-192,848,570.78	-192,848,570.78
（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）	-45,904,278.78	-	46,591,978.04	687,699.26
其中：1. 基金申购款	514,302,888.75	-	359,847,247.34	874,150,136.09
2. 基金赎回款	-560,207,167.53	-	-313,255,269.30	-873,462,436.83
（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	335,576,804.15	-	172,774,137.11	508,350,941.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城量化小盘股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]第 2169 号《关于准予景顺长城量化小盘股票型证券投资基金注册的批复》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《景顺长城量化小盘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人民币 1,783,703,963.03 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(2018)第 0090 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,784,551,427.10 份基金份额,其中认购资金利息折合 847,464.07 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债等)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为 80-95%,投资于小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%,除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-20%,每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需要缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府证券不低于基金净资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率 X95%+银行活期存款利率(税后)X5%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持

证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价

格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中基协字[2022]566 号《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于

资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前(如适用)运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起(如适用)产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	活期存款	85,365,489.72		29,280,457.86
等于：本金	85,356,114.15		29,277,382.48	
加：应计利息	9,375.57		3,075.38	
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	85,365,489.72		29,280,457.86	

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,228,457,470.54	-	1,204,657,343.66	-23,800,126.88	
贵金属投资-金交 所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市 场	1,096,000.00	88.25	1,174,580.01	78,491.76
	银行间市 场	-	-	-	-
	合计	1,096,000.00	88.25	1,174,580.01	78,491.76
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,229,553,470.54	88.25	1,205,831,923.67	-23,721,635.12	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	

股票		509,172,733.15	-	479,660,016.70	-29,512,716.45
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		509,172,733.15	-	479,660,016.70	-29,512,716.45

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	32,161,680.00	-	-	-
其中：股指期货投资	32,161,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	32,161,680.00	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2402	中证1000股指期货2402合约	10.00	11,729,600.00	362,360.00
IM2403	中证1000股指期货2403合约	18.00	21,047,760.00	253,320.00
合计				615,680.00

减：可抵销期货 暂收款				615,680.00
净额				-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末的买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末债权投资余额为零。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末债权投资余额为零。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末其他债权投资余额为零。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末其他债权投资余额为零。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末其他资产余额为零。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	369.50	5,613.07
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	4,281,593.95	2,221,240.45
其中：交易所市场	4,281,593.95	2,221,240.45
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	210,000.00	180,000.00
合计	4,491,963.45	2,406,853.52

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	335,576,804.15	335,576,804.15
本期申购	937,425,732.34	937,425,732.34
本期赎回（以“-”号填列）	-186,280,133.44	-186,280,133.44
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	1,086,722,403.05	1,086,722,403.05

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	213,142,312.84	-40,368,175.73	172,774,137.11
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	213,142,312.84	-40,368,175.73	172,774,137.11
本期利润	-97,495,803.07	6,406,761.33	-91,089,041.74

本期基金份额交易产生的变动数	484,235,932.19	-36,046,395.37	448,189,536.82
其中：基金申购款	583,062,400.37	-49,194,592.11	533,867,808.26
基金赎回款	-98,826,468.18	13,148,196.74	-85,678,271.44
本期已分配利润	-306,205,651.22	-	-306,205,651.22
本期末	293,676,790.74	-70,007,809.77	223,668,980.97

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	291,992.96	195,079.58
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	455,179.28	83,711.53
其他	6,065.30	5,089.48
合计	753,237.54	283,880.59

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-93,253,478.78	-151,352,807.91
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	-93,253,478.78	-151,352,807.91

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	8,344,487,285.38	7,145,310,740.95
减：卖出股票成本总额	8,413,259,757.55	7,274,983,003.69
减：交易费用	24,481,006.61	21,680,545.17
买卖股票差价收入	-93,253,478.78	-151,352,807.91

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
债券投资收益——利息收入	1,297.81	729.52
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,728,708.53	670,770.64
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	1,730,006.34	671,500.16

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,052,919.71	3,356,179.18
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,322,600.00	2,684,500.00
减：应计利息总额	1,248.38	788.40
减：交易费用	362.80	120.14
买卖债券差价收入	1,728,708.53	670,770.64

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股指期货投资收益	-4,618,098.49	-

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	16,658,468.20	9,095,302.64
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	16,658,468.20	9,095,302.64

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	5,791,081.33	-39,695,788.41
股票投资	5,712,589.57	-39,593,388.41
债券投资	78,491.76	-102,400.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	615,680.00	-

权证投资	-	-
期货投资	615,680.00	-
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	6,406,761.33	-39,695,788.41

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	477,635.69	1,374,002.73
基金转换费收入	16,122.47	701,445.00
合计	493,758.16	2,075,447.73

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	90,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	5,770.92	8,246.82
其他	360.00	360.00
合计	216,130.92	188,606.82

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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	基金管理人的股东

开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	54,301,490.41	0.31	186,643,089.90	1.31

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31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	50,990.59	0.31	27,170.75	0.63
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	173,815.23	1.31	173,815.23	7.83

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	16,322,969.98	11,774,996.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,128,486.43	3,117,570.45
应支付基金管理人的净管理费	14,194,483.55	8,657,426.26

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

根据《景顺长城基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 22 日起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.2\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,720,494.95	1,962,499.45

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

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

根据《景顺长城基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 22 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期	85,365,489.72	291,992.96	29,280,457.86	195,079.58

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2023年6月28日	2023年6月28日	2.3800	234,809,936.18	26,400,894.18	261,210,830.36	-
2	2023年12月28日	2023年12月28日	0.4200	26,638,942.84	18,355,878.02	44,994,820.86	-
合计	-	-	2.8000	261,448,879.02	44,756,772.20	306,205,651.22	-

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股流通受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股流通受限	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
300904	威力传动	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301413	安培龙	2023年12	6个月	新股	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-

		月 11 日		流通受限						
301421	波长光电	2023 年 8 月 16 日	6 个月	新股流通受限	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301456	盘古智能	2023 年 7 月 6 日	6 个月	新股流通受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301459	丰茂股份	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301487	盟固利	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301498	乖宝宠物	2023 年 8 月 9 日	6 个月	新股流通受限	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301499	维科精密	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301505	苏州规划	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023 年 8 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	6 个月	新股流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301509	金凯生科	2023 年 7 月 26 日	6 个月	新股流通受限	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-
301510	固高科技	2023 年 8 月 4 日	6 个月	新股流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301515	港通医疗	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股流通受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-

301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股 流通 受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股 流通 受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股 流通 受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股 流通 受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股 流通 受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股 流通 受限	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股 流通 受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股 流通 受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股 流通 受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股 流通 受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股 流通 受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股 流通 受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股 流通 受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股 流通 受限	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股 流通	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-

				受限						
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股 流通 受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股 流通 受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股 流通 受限	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股 流通 受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股 流通 受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股 流通 受限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股 流通 受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股 流通 受限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股 流通 受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股 流通 受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股 流通 受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股 流通 受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股 流通 受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603275	众辰科技	2023年8月16日	6个月	新股 流通 受限	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
603276	恒兴新材	2023年9	6个月	新股	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-

		月 18 日		流通受限						
603296	华勤技术	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股流通受限	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	-
603373	安邦护卫	2023 年 12 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688450	光格科技	2023 年 7 月 17 日	6 个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新股流通受限	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688549	中巨芯	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股流通受限	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688563	航材股份	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股流通受限	78.99	60.49	1,195	94,393.05	72,285.55	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月以上	新股流通受限	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
688591	泰凌微	2023 年 8 月 18 日	6 个月	新股流通受限	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688592	司南导航	2023 年 8 月 7 日	6 个月	新股流通受限	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688602	康鹏科技	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股流通受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688612	威迈斯	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688627	精智达	2023 年 7 月 11 日	6 个月	新股流通受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688646	逸飞激光	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股流通受限	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-

688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股 流通 受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股 流通 受限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股 流通 受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股 流通 受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股 流通 受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股 流通 受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股 流通 受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股 流通 受限	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股 流通 受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股 流通 受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股 流通 受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113069	博23转债	2023年12月25日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	6,960	696,000.00	696,045.76	-
118046	诺泰转债	2023年12月18日	1-6个月(含))	新债未上市	100.00	100.01	110	11,000.00	11,000.82	-
127100	神码转债	2023年12	1个月内	新债	100.00	100.01	2,454	245,400.00	245,417.75	-

		月 21 日	(含)	未上市					
--	--	--------	-----	-----	--	--	--	--	--

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库, 对发行人及债券投资进行内部评级, 对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度, 以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行; 本基金存放定期存款前, 均对交易对

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

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

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.09%（上年度末：0.00%）。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的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 7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	85,365,489.72	-	-	-	-	-	85,365,489.72
结算备付金	31,032,622.31	-	-	-	-	-	31,032,622.31

存出保证金	290,896.96	-	-	-	-	3,933,283.20	4,224,180.16
交易性金融资产	-	-	-696,045.76	478,534.25	1,204,657,343.66	1,205,831,923.67	
应收申购款	-	-	-	-	-	86,042.14	86,042.14
资产总计	116,689,008.99	-	-696,045.76	478,534.25	1,208,676,669.00	1,326,540,258.00	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	245,958.94	245,958.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,391,377.54	1,391,377.54
应付托管费	-	-	-	-	-	231,896.27	231,896.27
应付清算款	-	-	-	-	-	9,787,675.00	9,787,675.00
应交税费	-	-	-	-	-	2.78	2.78
其他负债	-	-	-	-	-	4,491,963.45	4,491,963.45
负债总计	-	-	-	-	-	16,148,873.98	16,148,873.98
利率敏感度缺口	116,689,008.99	-	-696,045.76	478,534.25	-	-	-
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个 月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	29,280,457.86	-	-	-	-	-	29,280,457.86
结算备付金	2,485,449.52	-	-	-	-	-	2,485,449.52
存出保证金	316,290.19	-	-	-	-	-	316,290.19
交易性金融资产	-	-	-	-	-	479,660,016.70	479,660,016.70
应收申购款	-	-	-	-	-	166,612.93	166,612.93
应收清算款	-	-	-	-	-	3,765,276.40	3,765,276.40
资产总计	32,082,197.57	-	-	-	-	483,591,906.03	515,674,103.60
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,106,948.22	1,106,948.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	702,986.93	702,986.93
应付托管	-	-	-	-	-	117,164.47	117,164.47

费							
应付清算款						2,989,206.15	2,989,206.15
应交税费						3.05	3.05
其他负债						2,406,853.52	2,406,853.52
负债总计						7,323,162.34	7,323,162.34
利率敏感度缺口	32,082,197.57						

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.09%（上年度末：0.00%），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）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,204,657,343.66	91.93	479,660,016.70	94.36
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	1,204,657,343.66	91.93	479,660,016.70	94.36

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注：7.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	59,989,528.39	14,084,582.58
沪深 300 指数下降 5%	-59,989,528.39	-14,084,582.58	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,203,732,616.15	476,525,479.19
第二层次	977,522.49	1,469,297.52
第三层次	1,121,785.03	1,665,239.99
合计	1,205,831,923.67	479,660,016.70

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,665,239.99	1,665,239.99
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	956,613.79	956,613.79
转出第三层次	-	1,665,239.99	1,665,239.99
当期利得或损失总额	-	165,171.24	165,171.24
其中：计入损益的利得或损失	-	165,171.24	165,171.24
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,121,785.03	1,121,785.03
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	165,171.24	165,171.24
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,806,556.46	1,806,556.46
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-141,316.47	-141,316.47
其中：计入损益的利得或损失	-	-141,316.47	-141,316.47
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,665,239.99	1,665,239.99
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未	-	-141,316.47	-141,316.47

实现利得或损失的变动— —公允价值变动损益			
--------------------------	--	--	--

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,121,785.03	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,665,239.99	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1891-2.4756	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	1,204,657,343.66	90.81
	其中：股票	1,204,657,343.66	90.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,174,580.01	0.09
	其中：债券	1,174,580.01	0.09
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	116,398,112.03	8.77
8	其他各项资产	4,310,222.30	0.32
9	合计	1,326,540,258.00	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	7,522,017.00	0.57
B	采矿业	23,195,495.76	1.77
C	制造业	799,747,149.19	61.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,783,033.00	1.51
E	建筑业	30,185,018.13	2.30
F	批发和零售业	61,160,195.69	4.67
G	交通运输、仓储和邮政业	19,712,036.76	1.50
H	住宿和餐饮业	3,767,400.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技术服务业	135,358,238.85	10.33
J	金融业	14,935,764.92	1.14
K	房地产业	28,112,431.56	2.15
L	租赁和商务服务业	4,045,216.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	15,180,561.36	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	9,287,293.82	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,440,554.00	0.95
R	文化、体育和娱乐业	20,224,937.62	1.54
S	综合	-	-
	合计	1,204,657,343.66	91.93

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002456	欧菲光	1,161,100	10,113,181.00	0.77
2	603530	神马电力	396,000	8,213,040.00	0.63
3	688298	东方生物	228,276	8,163,149.76	0.62
4	688235	百济神州	58,172	8,088,234.88	0.62

5	603505	金石资源	292,400	7,938,660.00	0.61
6	002320	海峡股份	1,306,645	7,617,740.35	0.58
7	000597	东北制药	1,375,000	7,356,250.00	0.56
8	000990	诚志股份	882,148	7,242,435.08	0.55
9	300398	飞凯材料	446,800	7,041,568.00	0.54
10	600312	平高电气	554,363	7,034,866.47	0.54
11	300455	航天智装	569,300	6,797,442.00	0.52
12	002436	兴森科技	461,100	6,792,003.00	0.52
13	600480	凌云股份	745,088	6,787,751.68	0.52
14	002488	金固股份	943,600	6,775,048.00	0.52
15	300170	汉得信息	806,252	6,699,954.12	0.51
16	002276	万马股份	650,215	6,645,197.30	0.51
17	000928	中钢国际	1,120,916	6,534,940.28	0.50
18	000813	德展健康	1,991,200	6,511,224.00	0.50
19	300458	全志科技	286,300	6,496,147.00	0.50
20	601028	玉龙股份	606,200	6,492,402.00	0.50
21	002390	信邦制药	1,415,600	6,285,264.00	0.48
22	300476	胜宏科技	340,000	6,273,000.00	0.48
23	688185	康希诺	82,736	6,165,486.72	0.47
24	603306	华懋科技	223,800	6,067,218.00	0.46
25	600363	联创光电	173,700	5,905,800.00	0.45
26	601890	亚星锚链	586,800	5,809,320.00	0.44
27	300123	亚光科技	781,000	5,724,730.00	0.44
28	600595	中孚实业	1,637,600	5,698,848.00	0.43
29	002041	登海种业	428,900	5,674,347.00	0.43
30	603229	奥翔药业	425,300	5,618,213.00	0.43
31	300323	华灿光电	765,900	5,606,388.00	0.43
32	300101	振芯科技	245,000	5,593,350.00	0.43
33	300346	南大光电	196,445	5,423,846.45	0.41
34	002036	联创电子	524,100	5,351,061.00	0.41
35	688700	东威科技	87,536	5,341,446.72	0.41
36	300188	国投智能	327,000	5,238,540.00	0.40
37	002396	星网锐捷	289,857	5,237,715.99	0.40
38	300379	东方通	284,400	5,198,832.00	0.40
39	000969	安泰科技	578,000	5,196,220.00	0.40
40	603368	柳药集团	274,600	5,195,432.00	0.40
41	600850	电科数字	238,200	5,180,850.00	0.40
42	600612	老凤祥	74,459	5,137,671.00	0.39
43	000543	皖能电力	818,700	5,125,062.00	0.39
44	600206	有研新材	412,761	5,114,108.79	0.39
45	600872	中炬高新	181,900	5,111,390.00	0.39
46	002283	天润工业	872,883	5,106,365.55	0.39
47	300236	上海新阳	144,100	5,075,202.00	0.39

48	300348	长亮科技	490,800	5,060,148.00	0.39
49	002649	博彦科技	411,190	5,045,301.30	0.39
50	002038	双鹭药业	495,100	5,045,069.00	0.39
51	688518	联赢激光	245,911	5,036,257.28	0.38
52	002006	精工科技	325,200	4,969,056.00	0.38
53	603033	三维股份	312,211	4,936,055.91	0.38
54	600797	浙大网新	748,400	4,909,504.00	0.37
55	300180	华峰超纤	1,108,800	4,900,896.00	0.37
56	600037	歌华有线	632,900	4,892,317.00	0.37
57	000829	天音控股	511,700	4,881,618.00	0.37
58	000951	中国重汽	364,700	4,872,392.00	0.37
59	000555	神州信息	431,202	4,868,270.58	0.37
60	300671	富满微	150,500	4,865,665.00	0.37
61	000090	天健集团	1,057,423	4,864,145.80	0.37
62	603328	依顿电子	593,700	4,838,655.00	0.37
63	301060	兰卫医学	362,000	4,810,980.00	0.37
64	002091	江苏国泰	614,200	4,809,186.00	0.37
65	601777	力帆科技	1,341,000	4,800,780.00	0.37
66	600295	鄂尔多斯	493,940	4,791,218.00	0.37
67	688439	振华风光	53,604	4,776,652.44	0.36
68	601137	博威合金	307,500	4,775,475.00	0.36
69	301071	力量钻石	147,289	4,757,434.70	0.36
70	688733	壹石通	162,196	4,747,476.92	0.36
71	603636	南威软件	369,900	4,742,118.00	0.36
72	688339	亿华通	103,608	4,739,029.92	0.36
73	603920	世运电路	258,300	4,721,724.00	0.36
74	688048	长光华芯	75,146	4,709,399.82	0.36
75	002428	云南锗业	381,100	4,698,963.00	0.36
76	000006	深振业A	1,022,800	4,694,652.00	0.36
77	600531	豫光金铅	774,501	4,685,731.05	0.36
78	600100	同方股份	635,000	4,667,250.00	0.36
79	002741	光华科技	313,800	4,666,206.00	0.36
80	603938	三孚股份	259,380	4,663,652.40	0.36
81	601019	山东出版	496,007	4,652,545.66	0.36
82	603297	永新光学	46,800	4,649,580.00	0.35
83	600449	宁夏建材	258,900	4,642,077.00	0.35
84	300134	大富科技	449,800	4,641,936.00	0.35
85	600456	宝钛股份	147,580	4,632,536.20	0.35
86	000600	建投能源	923,800	4,628,238.00	0.35
87	300768	迪普科技	312,900	4,624,662.00	0.35
88	002194	武汉凡谷	467,480	4,609,352.80	0.35
89	688800	瑞可达	114,695	4,608,445.10	0.35
90	603439	贵州三力	244,000	4,606,720.00	0.35

91	002402	和而泰	322,364	4,606,581.56	0.35
92	688268	华特气体	68,363	4,606,298.94	0.35
93	300527	中船应急	599,905	4,571,276.10	0.35
94	002534	西子洁能	365,800	4,568,842.00	0.35
95	301293	三博脑科	73,100	4,562,902.00	0.35
96	301217	铜冠铜箔	384,100	4,555,426.00	0.35
97	600643	爱建集团	892,773	4,553,142.30	0.35
98	301087	可孚医疗	119,930	4,545,347.00	0.35
99	000029	深深房 A	386,400	4,544,064.00	0.35
100	688238	和元生物	503,902	4,530,078.98	0.35
101	002212	天融信	461,801	4,516,413.78	0.34
102	300224	正海磁材	383,100	4,489,932.00	0.34
103	600556	天下秀	758,500	4,482,735.00	0.34
104	300579	数字认证	172,500	4,460,850.00	0.34
105	600266	城建发展	918,379	4,444,954.36	0.34
106	000019	深粮控股	587,500	4,429,750.00	0.34
107	603132	金徽股份	321,800	4,402,224.00	0.34
108	600986	浙文互联	801,900	4,378,374.00	0.33
109	002335	科华数据	157,900	4,370,672.00	0.33
110	605365	立达信	234,500	4,364,045.00	0.33
111	301165	锐捷网络	114,997	4,357,236.33	0.33
112	002249	大洋电机	872,000	4,333,840.00	0.33
113	300627	华测导航	139,294	4,320,899.88	0.33
114	600649	城投控股	1,166,200	4,314,940.00	0.33
115	603027	千禾味业	266,400	4,307,688.00	0.33
116	000901	航天科技	460,900	4,295,588.00	0.33
117	002706	良信股份	483,600	4,270,188.00	0.33
118	000690	宝新能源	963,100	4,266,533.00	0.33
119	601068	中铝国际	919,900	4,249,938.00	0.32
120	600740	山西焦化	837,700	4,222,008.00	0.32
121	603197	保隆科技	74,800	4,218,720.00	0.32
122	300460	惠伦晶体	342,500	4,199,050.00	0.32
123	000034	神州数码	140,200	4,193,382.00	0.32
124	300887	谱尼测试	354,600	4,187,826.00	0.32
125	300639	凯普生物	446,800	4,173,112.00	0.32
126	601700	风范股份	831,600	4,166,316.00	0.32
127	000062	深圳华强	367,790	4,144,993.30	0.32
128	002467	二六三	891,840	4,138,137.60	0.32
129	600502	安徽建工	883,977	4,110,493.05	0.31
130	002051	中工国际	506,000	4,108,720.00	0.31
131	603588	高能环境	626,000	4,094,040.00	0.31
132	002152	广电运通	333,900	4,093,614.00	0.31
133	600618	氯碱化工	449,800	4,093,180.00	0.31

134	601811	新华文轩	299,600	4,092,536.00	0.31
135	688128	中国电研	199,166	4,086,886.32	0.31
136	002472	双环传动	156,900	4,082,538.00	0.31
137	300442	润泽科技	160,700	4,076,959.00	0.31
138	300024	机器人	343,400	4,076,158.00	0.31
139	002158	汉钟精机	182,322	4,058,487.72	0.31
140	300001	特锐德	201,700	4,054,170.00	0.31
141	002268	电科网安	179,900	4,040,554.00	0.31
142	000566	海南海药	893,700	4,039,524.00	0.31
143	600161	天坛生物	130,500	4,037,670.00	0.31
144	000059	华锦股份	732,200	4,019,778.00	0.31
145	603876	鼎胜新材	319,500	4,003,335.00	0.31
146	600180	瑞茂通	656,900	4,000,521.00	0.31
147	002773	康弘药业	215,800	3,979,352.00	0.30
148	600998	九州通	559,200	3,919,992.00	0.30
149	300702	天宇股份	180,300	3,914,313.00	0.30
150	600348	华阳股份	399,400	3,898,144.00	0.30
151	603053	成都燃气	378,500	3,875,840.00	0.30
152	301017	漱玉平民	189,500	3,871,485.00	0.30
153	605589	圣泉集团	172,699	3,865,003.62	0.29
154	688131	皓元医药	73,782	3,841,090.92	0.29
155	600623	华谊集团	594,500	3,828,580.00	0.29
156	600252	中恒集团	1,521,600	3,819,216.00	0.29
157	601609	金田股份	559,300	3,786,461.00	0.29
158	300942	易瑞生物	323,100	3,777,039.00	0.29
159	601921	浙版传媒	494,100	3,774,924.00	0.29
160	300997	欢乐家	270,200	3,774,694.00	0.29
161	600754	锦江酒店	126,000	3,767,400.00	0.29
162	600526	菲达环保	759,500	3,751,930.00	0.29
163	603610	麒盛科技	314,328	3,746,789.76	0.29
164	605138	盛泰集团	483,100	3,744,025.00	0.29
165	002583	海能达	619,800	3,687,810.00	0.28
166	300811	铂科新材	69,000	3,648,030.00	0.28
167	300457	赢合科技	197,530	3,642,453.20	0.28
168	301207	华兰疫苗	130,100	3,616,780.00	0.28
169	300113	顺网科技	257,700	3,607,800.00	0.28
170	002215	诺普信	435,700	3,598,882.00	0.27
171	002646	天佑德酒	264,215	3,595,966.15	0.27
172	600861	北京人力	189,600	3,553,104.00	0.27
173	300741	华宝股份	165,600	3,545,496.00	0.27
174	600389	江山股份	203,299	3,537,402.60	0.27
175	000737	北方铜业	607,800	3,525,240.00	0.27
176	605168	三人行	55,400	3,510,144.00	0.27

177	600007	中国国贸	181,000	3,507,780.00	0.27
178	000528	柳工	519,185	3,499,306.90	0.27
179	600446	金证股份	301,200	3,484,884.00	0.27
180	688035	德邦科技	64,991	3,467,919.76	0.26
181	002351	漫步者	193,300	3,415,611.00	0.26
182	300119	瑞普生物	205,541	3,368,816.99	0.26
183	000650	仁和药业	496,600	3,292,458.00	0.25
184	002023	海特高新	358,400	3,261,440.00	0.25
185	003012	东鹏控股	386,300	3,186,975.00	0.24
186	002287	奇正藏药	141,200	3,175,588.00	0.24
187	603063	禾望电气	126,900	3,172,500.00	0.24
188	600639	浦东金桥	309,600	3,130,056.00	0.24
189	002895	川恒股份	164,700	3,129,300.00	0.24
190	300002	神州泰岳	350,700	3,103,695.00	0.24
191	002405	四维图新	348,700	3,103,430.00	0.24
192	000035	中国天楹	627,800	3,101,332.00	0.24
193	603713	密尔克卫	58,100	3,091,501.00	0.24
194	601101	吴华能源	487,443	3,080,639.76	0.24
195	301180	万祥科技	168,800	3,053,592.00	0.23
196	000921	海信家电	148,700	3,033,480.00	0.23
197	603618	杭电股份	470,000	3,008,000.00	0.23
198	300143	盈康生命	276,900	2,943,447.00	0.22
199	600572	康恩贝	575,100	2,904,255.00	0.22
200	300319	麦捷科技	300,600	2,897,784.00	0.22
201	300377	赢时胜	373,298	2,896,792.48	0.22
202	603123	翠微股份	271,308	2,889,430.20	0.22
203	300463	迈克生物	191,500	2,885,905.00	0.22
204	603093	南华期货	238,800	2,865,600.00	0.22
205	688556	高测股份	72,953	2,844,437.47	0.22
206	601126	四方股份	199,900	2,830,584.00	0.22
207	301325	曼恩斯特	36,500	2,830,210.00	0.22
208	600587	新华医疗	107,800	2,780,162.00	0.21
209	600320	振华重工	816,100	2,709,452.00	0.21
210	600391	航发科技	138,700	2,651,944.00	0.20
211	002182	宝武镁业	130,800	2,571,528.00	0.20
212	605111	新洁能	67,660	2,559,577.80	0.20
213	603826	坤彩科技	43,100	2,544,193.00	0.19
214	600120	浙江东方	705,800	2,533,822.00	0.19
215	688158	优刻得	153,342	2,522,475.90	0.19
216	002928	华夏航空	348,500	2,488,290.00	0.19
217	002819	东方中科	94,100	2,409,901.00	0.18
218	603919	金徽酒	97,300	2,395,526.00	0.18
219	002130	沃尔核材	316,708	2,391,145.40	0.18

220	688018	乐鑫科技	23,016	2,369,497.20	0.18
221	688711	宏微科技	56,789	2,356,175.61	0.18
222	688037	芯源微	17,589	2,350,066.29	0.18
223	603801	志邦家居	139,200	2,334,384.00	0.18
224	300303	聚飞光电	392,000	2,324,560.00	0.18
225	002303	美盈森	657,100	2,306,421.00	0.18
226	605007	五洲特纸	156,500	2,302,115.00	0.18
227	603032	德新科技	111,200	2,257,360.00	0.17
228	002745	木林森	259,400	2,246,404.00	0.17
229	600366	宁波韵升	287,400	2,233,098.00	0.17
230	002079	苏州固锟	197,700	2,230,056.00	0.17
231	300973	立高食品	45,600	2,213,880.00	0.17
232	600860	京城股份	164,600	2,203,994.00	0.17
233	603187	海容冷链	143,400	2,173,944.00	0.17
234	688027	国盾量子	16,400	2,097,560.00	0.16
235	300451	创业慧康	318,600	2,086,830.00	0.16
236	300172	中电环保	387,700	2,081,949.00	0.16
237	601801	皖新传媒	299,460	2,081,247.00	0.16
238	002237	恒邦股份	191,800	2,067,604.00	0.16
239	300856	科思股份	33,200	2,066,036.00	0.16
240	688300	联瑞新材	38,876	2,058,484.20	0.16
241	600977	中国电影	167,604	2,051,472.96	0.16
242	300882	万胜智能	84,200	2,051,112.00	0.16
243	600284	浦东建设	324,300	2,043,090.00	0.16
244	000811	冰轮环境	148,700	2,017,859.00	0.15
245	001205	盛航股份	123,100	2,015,147.00	0.15
246	002446	盛路通信	242,500	2,012,750.00	0.15
247	600211	西藏药业	41,102	2,005,777.60	0.15
248	603567	珍宝岛	162,800	1,979,648.00	0.15
249	002065	东华软件	318,800	1,966,996.00	0.15
250	688083	中望软件	19,500	1,941,030.00	0.15
251	002612	朗姿股份	100,701	1,936,480.23	0.15
252	603131	上海沪工	131,100	1,935,036.00	0.15
253	300366	创意信息	145,300	1,906,336.00	0.15
254	300806	斯迪克	135,020	1,899,731.40	0.14
255	600399	抚顺特钢	191,800	1,864,296.00	0.14
256	600609	金杯汽车	382,300	1,857,978.00	0.14
257	002822	中装建设	422,600	1,850,988.00	0.14
258	002124	天邦食品	509,000	1,847,670.00	0.14
259	002991	甘源食品	25,800	1,843,668.00	0.14
260	603236	移远通信	34,300	1,843,625.00	0.14
261	002206	海利得	366,886	1,841,767.72	0.14
262	300327	中颖电子	79,800	1,819,440.00	0.14

263	300342	天银机电	117,300	1,802,901.00	0.14
264	601528	瑞丰银行	357,600	1,770,120.00	0.14
265	603861	白云电器	175,200	1,713,456.00	0.13
266	688110	东芯股份	49,476	1,703,458.68	0.13
267	688521	芯原股份	33,634	1,680,354.64	0.13
268	603005	晶方科技	76,260	1,674,669.60	0.13
269	601677	明泰铝业	147,200	1,669,248.00	0.13
270	603887	城地香江	206,300	1,658,652.00	0.13
271	301219	腾远钴业	41,815	1,646,256.55	0.13
272	300065	海兰信	158,900	1,616,013.00	0.12
273	600710	苏美达	226,500	1,605,885.00	0.12
274	300409	道氏技术	143,700	1,600,818.00	0.12
275	688326	经纬恒润	13,700	1,589,885.00	0.12
276	000529	广弘控股	232,600	1,579,354.00	0.12
277	603983	丸美股份	62,300	1,574,321.00	0.12
278	603228	景旺电子	69,300	1,563,408.00	0.12
279	301179	泽宇智能	60,100	1,559,595.00	0.12
280	600880	博瑞传播	308,500	1,545,585.00	0.12
281	600771	广誉远	56,600	1,527,634.00	0.12
282	300222	科大智能	207,439	1,526,751.04	0.12
283	601866	中远海发	649,600	1,520,064.00	0.12
284	000727	冠捷科技	557,900	1,495,172.00	0.11
285	300726	宏达电子	49,500	1,494,405.00	0.11
286	300846	首都在线	102,600	1,466,154.00	0.11
287	600350	山东高速	210,400	1,460,176.00	0.11
288	300039	上海凯宝	216,500	1,439,725.00	0.11
289	002217	合力泰	526,200	1,431,264.00	0.11
290	601333	广深铁路	551,900	1,429,421.00	0.11
291	301123	奕东电子	57,000	1,337,220.00	0.10
292	300674	宇信科技	78,564	1,279,021.92	0.10
293	603110	东方材料	52,200	1,258,020.00	0.10
294	002792	通宇通讯	74,400	1,246,944.00	0.10
295	603979	金诚信	32,500	1,227,200.00	0.09
296	688016	心脉医疗	6,300	1,226,169.00	0.09
297	603323	苏农银行	294,600	1,225,536.00	0.09
298	301080	百普赛斯	20,700	1,220,058.00	0.09
299	688289	圣湘生物	62,016	1,212,412.80	0.09
300	600667	太极实业	170,900	1,201,427.00	0.09
301	600458	时代新材	129,200	1,189,932.00	0.09
302	002913	奥士康	38,793	1,189,005.45	0.09
303	002453	华软科技	105,000	1,186,500.00	0.09
304	000151	中成股份	104,400	1,182,852.00	0.09
305	300130	新国都	48,700	1,178,540.00	0.09

306	603689	皖天然气	133,700	1,161,853.00	0.09
307	600459	贵研铂业	80,466	1,155,491.76	0.09
308	600851	海欣股份	167,100	1,147,977.00	0.09
309	300618	寒锐钴业	39,900	1,128,771.00	0.09
310	301155	海力风电	18,700	1,106,105.00	0.08
311	301078	孩子王	132,200	1,085,362.00	0.08
312	605598	上海港湾	40,200	1,075,752.00	0.08
313	600225	卓朗科技	282,700	1,074,260.00	0.08
314	300567	精测电子	12,000	1,051,440.00	0.08
315	002967	广电计量	69,100	1,037,191.00	0.08
316	688403	汇成股份	97,953	1,033,404.15	0.08
317	603881	数据港	51,863	1,027,924.66	0.08
318	301090	华润材料	94,500	1,026,270.00	0.08
319	603818	曲美家居	189,100	1,021,140.00	0.08
320	000818	航锦科技	31,600	991,608.00	0.08
321	002285	世联行	405,200	976,532.00	0.07
322	002859	洁美科技	38,700	965,565.00	0.07
323	300068	南都电源	73,900	956,266.00	0.07
324	002984	森麒麟	32,900	949,165.00	0.07
325	600637	东方明珠	126,200	949,024.00	0.07
326	000795	英洛华	152,100	947,583.00	0.07
327	600621	华鑫股份	66,800	939,876.00	0.07
328	002261	拓维信息	62,000	932,480.00	0.07
329	002747	埃斯顿	47,200	877,448.00	0.07
330	605388	均瑶健康	69,000	865,260.00	0.07
331	300271	华宇软件	105,626	865,076.94	0.07
332	002085	万丰奥威	173,400	856,596.00	0.07
333	300226	上海钢联	30,000	854,700.00	0.07
334	600729	重庆百货	30,000	846,000.00	0.06
335	002376	新北洋	111,000	845,820.00	0.06
336	601606	长城军工	66,900	814,842.00	0.06
337	688020	方邦股份	16,500	799,920.00	0.06
338	000426	兴业银锡	86,600	786,328.00	0.06
339	000411	英特集团	69,400	777,974.00	0.06
340	600201	生物股份	72,200	777,594.00	0.06
341	002891	中宠股份	28,960	763,096.00	0.06
342	000719	中原传媒	78,200	760,886.00	0.06
343	605299	舒华体育	74,600	738,540.00	0.06
344	000567	海德股份	68,200	724,966.00	0.06
345	600641	万业企业	40,900	705,934.00	0.05
346	688798	艾为电子	10,100	697,203.00	0.05
347	688003	天准科技	18,300	686,616.00	0.05
348	300666	江丰电子	11,685	684,507.30	0.05

349	300687	赛意信息	31,000	675,180.00	0.05
350	688023	安恒信息	6,041	669,886.49	0.05
351	600971	恒源煤电	56,300	627,745.00	0.05
352	002617	露笑科技	99,700	618,140.00	0.05
353	603208	江山欧派	20,500	608,645.00	0.05
354	688686	奥普特	5,400	604,800.00	0.05
355	000681	视觉中国	41,100	604,170.00	0.05
356	688665	四方光电	8,000	590,080.00	0.05
357	600172	黄河旋风	154,400	577,456.00	0.04
358	002585	双星新材	68,200	553,102.00	0.04
359	300369	绿盟科技	58,300	549,769.00	0.04
360	300773	拉卡拉	32,585	522,663.40	0.04
361	603599	广信股份	35,900	520,550.00	0.04
362	603520	司太立	35,700	502,656.00	0.04
363	688596	正帆科技	12,481	494,622.03	0.04
364	300102	乾照光电	66,597	489,487.95	0.04
365	600586	金晶科技	72,500	484,300.00	0.04
366	000030	富奥股份	89,100	475,794.00	0.04
367	002043	兔宝宝	52,200	462,492.00	0.04
368	603690	至纯科技	17,644	453,450.80	0.03
369	000550	江铃汽车	23,700	451,011.00	0.03
370	688327	云从科技	26,308	443,552.88	0.03
371	601918	新集能源	84,100	443,207.00	0.03
372	600498	烽火通信	24,700	411,008.00	0.03
373	300260	新莱应材	13,320	405,327.60	0.03
374	688630	芯碁微装	4,560	389,287.20	0.03
375	688033	天宜上佳	22,959	388,007.10	0.03
376	688198	佰仁医疗	3,000	373,590.00	0.03
377	300747	锐科激光	15,800	371,774.00	0.03
378	000682	东方电子	45,900	369,495.00	0.03
379	000552	甘肃能化	120,700	368,135.00	0.03
380	600551	时代出版	31,800	346,302.00	0.03
381	600602	云赛智联	29,600	342,472.00	0.03
382	300820	英杰电气	5,850	335,088.00	0.03
383	301046	能辉科技	12,100	328,152.00	0.03
384	600055	万东医疗	19,200	327,936.00	0.03
385	000718	苏宁环球	125,200	324,268.00	0.02
386	300294	博雅生物	9,500	319,960.00	0.02
387	000061	农产品	48,200	311,854.00	0.02
388	301366	一博科技	9,300	310,341.00	0.02
389	600197	伊力特	14,259	310,133.25	0.02
390	688209	英集芯	17,233	307,781.38	0.02
391	600216	浙江医药	28,600	306,878.00	0.02

392	601222	林洋能源	46,674	298,246.86	0.02
393	600648	外高桥	29,900	294,814.00	0.02
394	300382	斯莱克	28,500	283,005.00	0.02
395	000925	众合科技	32,600	282,316.00	0.02
396	600198	大唐电信	41,300	271,341.00	0.02
397	000685	中山公用	36,400	266,084.00	0.02
398	688166	博瑞医药	7,600	266,000.00	0.02
399	600738	丽尚国潮	49,000	260,680.00	0.02
400	301095	广立微	3,400	254,082.00	0.02
401	601311	骆驼股份	31,111	249,199.11	0.02
402	300378	鼎捷软件	11,500	245,065.00	0.02
403	603300	华铁应急	34,400	220,160.00	0.02
404	300332	天壕能源	26,500	210,675.00	0.02
405	603583	捷昌驱动	10,500	210,315.00	0.02
406	688102	斯瑞新材	15,400	203,126.00	0.02
407	688368	晶丰明源	1,781	192,241.14	0.01
408	688608	恒玄科技	1,189	183,427.03	0.01
409	002318	久立特材	8,800	174,944.00	0.01
410	688050	爱博医疗	1,000	172,040.00	0.01
411	300027	华谊兄弟	62,600	167,768.00	0.01
412	300036	超图软件	8,000	167,200.00	0.01
413	688408	中信博	2,300	165,025.00	0.01
414	002813	路畅科技	4,700	164,688.00	0.01
415	600761	安徽合力	8,897	162,014.37	0.01
416	600508	上海能源	11,400	158,004.00	0.01
417	600810	神马股份	21,200	157,728.00	0.01
418	000503	国新健康	11,900	156,842.00	0.01
419	688680	海优新材	2,342	153,752.30	0.01
420	603396	金辰股份	2,800	153,020.00	0.01
421	002701	奥瑞金	36,771	152,231.94	0.01
422	688366	昊海生科	1,400	151,606.00	0.01
423	300685	艾德生物	6,880	151,222.40	0.01
424	605090	九丰能源	5,400	150,822.00	0.01
425	688127	蓝特光学	6,400	149,056.00	0.01
426	300860	锋尚文化	2,700	147,501.00	0.01
427	600688	上海石化	51,400	147,004.00	0.01
428	002416	爱施德	15,800	146,782.00	0.01
429	002233	塔牌集团	20,600	145,848.00	0.01
430	688578	艾力斯	3,500	145,810.00	0.01
431	000627	天茂集团	51,300	145,692.00	0.01
432	600248	陕建股份	36,200	145,524.00	0.01
433	603171	税友股份	4,100	145,058.00	0.01
434	605376	博迁新材	5,100	143,820.00	0.01

435	688389	普门科技	6,300	141,813.00	0.01
436	601375	中原证券	36,914	141,380.62	0.01
437	603105	芯能科技	12,200	141,276.00	0.01
438	002705	新宝股份	9,600	139,872.00	0.01
439	300770	新媒股份	3,608	139,557.44	0.01
440	688508	芯朋微	2,761	135,868.81	0.01
441	300762	上海瀚讯	8,900	134,212.00	0.01
442	688381	帝奥微	5,300	134,196.00	0.01
443	605222	起帆电缆	6,900	133,032.00	0.01
444	603989	艾华集团	6,168	132,735.36	0.01
445	300696	爱乐达	7,600	132,316.00	0.01
446	600059	古越龙山	14,000	130,200.00	0.01
447	688356	键凯科技	1,200	127,680.00	0.01
448	603730	岱美股份	8,700	126,063.00	0.01
449	600195	中牧股份	10,500	124,530.00	0.01
450	003006	百亚股份	8,200	124,312.00	0.01
451	688007	光峰科技	4,800	124,224.00	0.01
452	002978	安宁股份	3,900	123,474.00	0.01
453	000517	荣安地产	49,976	122,441.20	0.01
454	600675	中华企业	38,500	121,275.00	0.01
455	000560	我爱我家	53,700	120,825.00	0.01
456	002044	美年健康	20,100	120,801.00	0.01
457	300456	赛微电子	4,800	115,392.00	0.01
458	688499	利元亨	3,000	114,240.00	0.01
459	688322	奥比中光	3,000	112,740.00	0.01
460	002929	润建股份	2,700	112,671.00	0.01
461	688088	虹软科技	2,600	106,704.00	0.01
462	600331	宏达股份	20,600	105,678.00	0.01
463	002960	青鸟消防	7,500	103,800.00	0.01
464	300679	电连技术	2,500	103,750.00	0.01
465	600285	羚锐制药	5,975	102,232.25	0.01
466	688639	华恒生物	800	100,720.00	0.01
467	688278	特宝生物	1,900	99,465.00	0.01
468	600409	三友化工	16,400	90,036.00	0.01
469	688106	金宏气体	3,591	86,507.19	0.01
470	002645	华宏科技	7,600	85,880.00	0.01
471	002746	仙坛股份	11,618	81,790.72	0.01
472	000902	新洋丰	7,084	80,686.76	0.01
473	002174	游族网络	6,848	78,478.08	0.01
474	603279	景津装备	3,500	77,385.00	0.01
475	603565	中谷物流	9,200	75,716.00	0.01
476	301015	百洋医药	2,100	75,306.00	0.01
477	000923	河钢资源	4,400	73,920.00	0.01

478	688563	航材股份	1,195	72,285.55	0.01
479	603010	万盛股份	6,600	71,214.00	0.01
480	688122	西部超导	1,300	69,199.00	0.01
481	601001	晋控煤业	5,500	67,815.00	0.01
482	688568	中科星图	1,359	66,672.54	0.01
483	300233	金城医药	4,000	66,640.00	0.01
484	688100	威胜信息	2,300	66,516.00	0.01
485	000791	甘肃能源	11,700	65,169.00	0.00
486	002048	宁波华翔	4,914	63,931.14	0.00
487	600718	东软集团	6,900	63,825.00	0.00
488	601163	三角轮胎	4,200	60,522.00	0.00
489	688526	科前生物	2,829	57,655.02	0.00
490	603985	恒润股份	2,300	57,155.00	0.00
491	600751	海航科技	21,700	56,854.00	0.00
492	603997	继峰股份	4,100	55,227.00	0.00
493	002946	新乳业	4,800	55,104.00	0.00
494	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
495	603055	台华新材	4,000	48,160.00	0.00
496	603087	甘李药业	900	47,385.00	0.00
497	688072	拓荆科技	200	46,260.00	0.00
498	603296	华勤技术	593	46,105.75	0.00
499	002190	成飞集成	2,400	45,528.00	0.00
500	601208	东材科技	3,600	44,568.00	0.00
501	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
502	002214	大立科技	3,700	42,439.00	0.00
503	688372	伟测科技	534	41,865.60	0.00
504	603566	普莱柯	1,842	41,721.30	0.00
505	000982	中银绒业	26,100	38,367.00	0.00
506	300613	富瀚微	900	38,196.00	0.00
507	600536	中国软件	1,000	36,260.00	0.00
508	002903	宇环数控	1,400	35,770.00	0.00
509	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
510	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
511	603699	纽威股份	2,500	34,650.00	0.00
512	300604	长川科技	900	34,191.00	0.00
513	688082	盛美上海	325	33,933.25	0.00
514	002224	三力士	6,600	33,594.00	0.00
515	600098	广州发展	6,100	32,757.00	0.00
516	002314	南山控股	10,500	30,450.00	0.00
517	300470	中密控股	800	30,240.00	0.00
518	002274	华昌化工	4,000	30,200.00	0.00
519	603612	索通发展	1,900	29,241.00	0.00
520	688239	航宇科技	600	28,662.00	0.00

521	002961	瑞达期货	1,900	28,310.00	0.00
522	688200	华峰测控	228	27,998.40	0.00
523	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
524	601212	白银有色	9,900	26,631.00	0.00
525	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
526	300777	中简科技	879	26,220.57	0.00
527	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
528	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
529	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
530	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
531	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
532	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
533	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
534	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
535	688120	华海清科	105	19,708.50	0.00
536	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
537	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
538	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
539	300428	立中集团	900	19,008.00	0.00
540	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
541	002516	旷达科技	3,700	18,241.00	0.00
542	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
543	600993	马应龙	700	16,926.00	0.00
544	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
545	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
546	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
547	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
548	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
549	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
550	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
551	300480	光力科技	600	12,810.00	0.00
552	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
553	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
554	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
555	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
556	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
557	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
558	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
559	300203	聚光科技	700	11,095.00	0.00
560	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
561	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
562	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
563	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00

564	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
565	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
566	002421	达实智能	3,100	9,982.00	0.00
567	002088	鲁阳节能	700	9,975.00	0.00
568	603298	杭叉集团	400	9,952.00	0.00
569	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
570	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
571	300676	华大基因	200	9,600.00	0.00
572	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
573	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
574	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
575	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
576	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
577	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
578	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
579	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
580	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
581	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
582	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
583	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
584	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
585	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
586	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
587	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
588	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
589	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
590	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
591	002948	青岛银行	2,400	7,320.00	0.00
592	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
593	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
594	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
595	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
596	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
597	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
598	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
599	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
600	002068	黑猫股份	502	5,823.20	0.00
601	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
602	600577	精达股份	1,332	5,514.48	0.00
603	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
604	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
605	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
606	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00

607	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
608	605338	巴比食品	200	4,296.00	0.00
609	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
610	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
611	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
612	300767	震安科技	200	3,476.00	0.00
613	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
614	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
615	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
616	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
617	600750	江中药业	117	2,442.96	0.00
618	002219	新里程	800	2,424.00	0.00
619	300432	富临精工	200	2,100.00	0.00
620	300400	劲拓股份	100	1,629.00	0.00
621	300525	博思软件	100	1,492.00	0.00
622	600475	华光环能	100	1,040.00	0.00
623	300497	富祥药业	100	936.00	0.00
624	001696	宗申动力	100	663.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600797	浙大网新	41,896,486.00	8.24
2	002597	金禾实业	41,325,954.94	8.13
3	600572	康恩贝	38,998,100.00	7.67
4	301039	中集车辆	38,952,864.54	7.66
5	300036	超图软件	38,739,793.67	7.62
6	300775	三角防务	37,941,735.00	7.46
7	603118	共进股份	35,942,017.00	7.07
8	601137	博威合金	35,215,708.00	6.93
9	300232	洲明科技	34,678,554.00	6.82
10	605111	新洁能	34,174,181.48	6.72
11	600850	电科数字	33,792,143.00	6.65
12	002697	红旗连锁	33,016,238.00	6.49
13	600420	国药现代	32,968,881.63	6.49
14	600211	西藏药业	32,630,100.42	6.42
15	002402	和而泰	32,391,120.00	6.37
16	002044	美年健康	32,268,227.00	6.35
17	002237	恒邦股份	31,526,057.25	6.20
18	603368	柳药集团	31,407,861.68	6.18
19	600285	羚锐制药	31,204,875.54	6.14
20	000034	神州数码	31,159,014.00	6.13
21	002517	恺英网络	31,066,625.00	6.11

22	000758	中色股份	30,962,883.00	6.09
23	300674	宇信科技	30,498,913.87	6.00
24	002158	汉钟精机	30,449,293.46	5.99
25	600480	凌云股份	30,353,239.88	5.97
26	603345	安井食品	29,777,484.00	5.86
27	605589	圣泉集团	29,723,794.00	5.85
28	600073	上海梅林	29,661,091.00	5.83
29	300856	科思股份	29,224,026.03	5.75
30	300777	中简科技	28,906,893.00	5.69
31	600210	紫江企业	28,705,124.00	5.65
32	002283	天润工业	28,689,208.07	5.64
33	600064	南京高科	28,349,032.21	5.58
34	300119	瑞普生物	27,632,467.79	5.44
35	300638	广和通	27,363,210.47	5.38
36	688556	高测股份	27,335,781.91	5.38
37	002291	遥望科技	27,255,712.00	5.36
38	600458	时代新材	27,221,175.00	5.35
39	000951	中国重汽	27,150,792.72	5.34
40	603027	千禾味业	27,065,732.00	5.32
41	002139	拓邦股份	27,000,261.58	5.31
42	000555	神州信息	26,973,071.34	5.31
43	002126	银轮股份	26,906,348.94	5.29
44	601126	四方股份	26,849,482.00	5.28
45	600502	安徽建工	26,798,720.50	5.27
46	600750	江中药业	26,765,166.85	5.27
47	601921	浙版传媒	26,536,660.12	5.22
48	300226	上海钢联	26,517,990.30	5.22
49	600531	豫光金铅	26,372,250.00	5.19
50	000612	焦作万方	25,701,018.40	5.06
51	002649	博彦科技	25,289,789.69	4.97
52	605388	均瑶健康	25,164,806.25	4.95
53	301219	腾远钴业	24,867,596.18	4.89
54	002746	仙坛股份	24,843,947.40	4.89
55	000650	仁和药业	24,734,250.00	4.87
56	002421	达实智能	24,726,196.00	4.86
57	600129	太极集团	24,576,390.00	4.83
58	002233	塔牌集团	24,402,076.00	4.80
59	600057	厦门象屿	24,353,312.75	4.79
60	600789	鲁抗医药	24,216,067.00	4.76
61	002215	诺普信	24,171,586.00	4.75
62	000928	中钢国际	23,930,785.21	4.71
63	000933	神火股份	23,696,361.00	4.66
64	000567	海德股份	23,511,093.25	4.62

65	002747	埃斯顿	23,383,202.00	4.60
66	002276	万马股份	23,270,854.35	4.58
67	600612	老凤祥	23,118,560.00	4.55
68	002335	科华数据	23,089,267.00	4.54
69	300352	北信源	23,055,797.00	4.54
70	002610	爱康科技	22,923,772.00	4.51
71	002063	远光软件	22,834,634.53	4.49
72	002518	科士达	22,656,530.12	4.46
73	002558	巨人网络	22,643,806.00	4.45
74	600158	中体产业	22,423,514.97	4.41
75	601222	林洋能源	22,418,060.00	4.41
76	000917	电广传媒	22,344,703.96	4.40
77	002782	可立克	22,279,438.40	4.38
78	002611	东方精工	22,254,218.00	4.38
79	002706	良信股份	22,204,030.00	4.37
80	600587	新华医疗	22,159,393.00	4.36
81	601375	中原证券	22,051,244.00	4.34
82	300130	新国都	22,000,374.00	4.33
83	601908	京运通	21,971,344.00	4.32
84	002038	双鹭药业	21,967,424.98	4.32
85	300236	上海新阳	21,943,012.33	4.32
86	002413	雷科防务	21,935,948.00	4.32
87	000921	海信家电	21,930,088.75	4.31
88	603919	金徽酒	21,906,749.75	4.31
89	002967	广电计量	21,905,364.98	4.31
90	002463	沪电股份	21,882,525.00	4.30
91	603301	振德医疗	21,857,987.85	4.30
92	002768	国恩股份	21,856,214.28	4.30
93	002605	姚记科技	21,766,228.00	4.28
94	000528	柳 工	21,628,548.20	4.25
95	002456	欧菲光	21,620,901.00	4.25
96	000969	安泰科技	21,378,159.00	4.21
97	002895	川恒股份	21,092,390.00	4.15
98	002174	游族网络	21,084,634.12	4.15
99	600312	平高电气	20,985,853.65	4.13
100	603979	金诚信	20,966,398.00	4.12
101	300973	立高食品	20,877,628.00	4.11
102	600483	福能股份	20,790,889.46	4.09
103	688018	乐鑫科技	20,727,278.19	4.08
104	002017	东信和平	20,658,135.25	4.06
105	300118	东方日升	20,655,027.00	4.06
106	300348	长亮科技	20,577,419.00	4.05
107	600120	浙江东方	20,555,284.83	4.04

108	603236	移远通信	20,553,603.05	4.04
109	000048	京基智农	20,370,998.77	4.01
110	002212	天融信	20,353,835.29	4.00
111	002851	麦格米特	20,315,666.50	4.00
112	002865	钧达股份	20,120,146.41	3.96
113	000913	钱江摩托	19,947,201.00	3.92
114	002737	葵花药业	19,840,683.00	3.90
115	000517	荣安地产	19,721,977.00	3.88
116	603306	华懋科技	19,697,389.00	3.87
117	300398	飞凯材料	19,681,227.00	3.87
118	300123	亚光科技	19,649,663.00	3.87
119	300567	精测电子	19,614,809.00	3.86
120	002396	星网锐捷	19,491,199.00	3.83
121	002698	博实股份	19,249,747.77	3.79
122	600266	城建发展	19,220,346.56	3.78
123	601619	嘉泽新能	19,140,328.00	3.77
124	600267	海正药业	18,973,487.00	3.73
125	600459	贵研铂业	18,964,556.58	3.73
126	002324	普利特	18,872,999.54	3.71
127	300900	广联航空	18,851,709.00	3.71
128	002036	联创电子	18,822,532.00	3.70
129	000600	建投能源	18,612,006.00	3.66
130	688037	芯源微	18,463,785.01	3.63
131	600284	浦东建设	18,426,821.72	3.62
132	003012	东鹏控股	18,360,476.00	3.61
133	601519	大智慧	18,311,326.50	3.60
134	002079	苏州固锝	18,279,788.39	3.60
135	000915	华特达因	18,259,380.00	3.59
136	000423	东阿阿胶	18,227,802.02	3.59
137	601567	三星医疗	18,220,645.79	3.58
138	600197	伊力特	18,197,148.00	3.58
139	600662	外服控股	18,110,612.00	3.56
140	600577	精达股份	18,079,456.00	3.56
141	600481	双良节能	18,057,729.20	3.55
142	002979	雷赛智能	17,997,515.90	3.54
143	600320	振华重工	17,993,870.10	3.54
144	000893	亚钾国际	17,939,155.00	3.53
145	300827	上能电气	17,921,169.33	3.53
146	300068	南都电源	17,904,909.00	3.52
147	300002	神州泰岳	17,839,855.00	3.51
148	000690	宝新能源	17,650,197.00	3.47
149	003006	百亚股份	17,630,139.00	3.47
150	688707	振华新材	17,591,484.78	3.46

151	600761	安徽合力	17,559,491.06	3.45
152	603690	至纯科技	17,411,794.56	3.43
153	300109	新开源	17,315,301.67	3.41
154	688399	硕世生物	17,301,786.83	3.40
155	002006	精工科技	17,252,727.00	3.39
156	002815	崇达技术	17,240,315.51	3.39
157	600456	宝钛股份	17,196,976.00	3.38
158	688711	宏微科技	17,047,202.92	3.35
159	002449	国星光电	17,033,068.69	3.35
160	002467	二六三	16,991,004.00	3.34
161	300101	振芯科技	16,979,302.52	3.34
162	600685	中船防务	16,882,928.05	3.32
163	300451	创业慧康	16,797,684.68	3.30
164	600557	康缘药业	16,700,096.80	3.29
165	300031	宝通科技	16,624,305.50	3.27
166	600971	恒源煤电	16,619,565.00	3.27
167	600908	无锡银行	16,595,717.00	3.26
168	002446	盛路通信	16,460,557.05	3.24
169	300377	赢时胜	16,429,580.00	3.23
170	300303	聚飞光电	16,418,345.00	3.23
171	688298	东方生物	16,352,319.20	3.22
172	002918	蒙娜丽莎	16,280,387.00	3.20
173	300773	拉卡拉	16,210,293.35	3.19
174	300188	国投智能	15,995,785.00	3.15
175	603005	晶方科技	15,965,786.60	3.14
176	300298	三诺生物	15,963,672.00	3.14
177	688277	天智航	15,913,326.84	3.13
178	000811	冰轮环境	15,904,620.00	3.13
179	601686	友发集团	15,753,687.12	3.10
180	300872	天阳科技	15,688,804.80	3.09
181	300394	天孚通信	15,653,614.00	3.08
182	300855	图南股份	15,502,097.87	3.05
183	002987	京北方	15,499,469.51	3.05
184	300080	易成新能	15,429,696.00	3.04
185	002222	福晶科技	15,237,456.00	3.00
186	300672	国科微	15,205,540.11	2.99
187	002318	久立特材	15,160,542.00	2.98
188	603466	风语筑	15,111,699.60	2.97
189	002020	京新药业	15,060,723.00	2.96
190	000829	天音控股	15,013,847.77	2.95
191	000049	德赛电池	14,998,739.40	2.95
192	600864	哈投股份	14,988,596.00	2.95
193	301095	广立微	14,956,533.58	2.94

194	300382	斯莱克	14,920,678.00	2.94
195	600748	上实发展	14,871,398.00	2.93
196	300315	掌趣科技	14,813,471.00	2.91
197	300662	科锐国际	14,741,246.60	2.90
198	300170	汉得信息	14,688,869.84	2.89
199	605168	三人行	14,688,683.36	2.89
200	688066	航天宏图	14,526,321.65	2.86
201	300803	指南针	14,526,242.00	2.86
202	000566	海南海药	14,519,626.30	2.86
203	688516	奥特维	14,468,222.08	2.85
204	600639	浦东金桥	14,456,028.00	2.84
205	300762	上海瀚讯	14,324,571.60	2.82
206	002123	梦网科技	14,312,143.00	2.82
207	002085	万丰奥威	14,289,589.00	2.81
208	300079	数码视讯	14,286,179.60	2.81
209	000676	智度股份	14,274,417.72	2.81
210	002055	得润电子	14,210,945.00	2.80
211	603505	金石资源	14,154,222.52	2.78
212	603920	世运电路	14,102,610.00	2.77
213	002106	莱宝高科	14,046,618.00	2.76
214	688033	天宜上佳	14,013,937.53	2.76
215	002727	一心堂	13,974,838.54	2.75
216	002437	誉衡药业	13,946,613.00	2.74
217	688139	海尔生物	13,944,124.60	2.74
218	600370	三房巷	13,788,730.00	2.71
219	688508	芯朋微	13,742,122.32	2.70
220	002099	海翔药业	13,729,061.00	2.70
221	688800	瑞可达	13,665,773.74	2.69
222	002583	海能达	13,665,279.00	2.69
223	603323	苏农银行	13,658,358.00	2.69
224	002436	兴森科技	13,582,223.00	2.67
225	603103	横店影视	13,548,384.00	2.67
226	603881	数据港	13,389,659.92	2.63
227	300634	彩讯股份	13,367,258.00	2.63
228	002978	安宁股份	13,292,502.00	2.61
229	600490	鹏欣资源	13,259,468.00	2.61
230	603093	南华期货	13,241,548.00	2.60
231	600776	东方通信	13,175,391.00	2.59
232	002472	双环传动	13,155,496.00	2.59
233	600206	有研新材	13,144,200.36	2.59
234	002984	森麒麟	13,045,073.00	2.57
235	300842	帝科股份	13,043,614.00	2.57
236	300765	新诺威	12,983,526.42	2.55

237	688268	华特气体	12,973,891.99	2.55
238	000036	华联控股	12,964,804.00	2.55
239	000090	天健集团	12,892,521.00	2.54
240	600105	永鼎股份	12,889,337.35	2.54
241	600876	凯盛新能	12,883,035.00	2.53
242	688518	联赢激光	12,866,837.76	2.53
243	603876	鼎胜新材	12,793,536.40	2.52
244	600363	联创光电	12,782,064.00	2.51
245	600559	老白干酒	12,758,239.00	2.51
246	002773	康弘药业	12,755,436.00	2.51
247	688578	艾力斯	12,753,536.22	2.51
248	603328	依顿电子	12,732,896.00	2.50
249	601019	山东出版	12,732,290.00	2.50
250	002182	宝武镁业	12,718,281.51	2.50
251	600017	日照港	12,650,899.00	2.49
252	002240	盛新锂能	12,642,986.00	2.49
253	300869	康泰医学	12,618,598.55	2.48
254	600821	金开新能	12,574,813.00	2.47
255	603393	新天然气	12,518,193.00	2.46
256	603718	海利生物	12,509,694.69	2.46
257	300263	隆华科技	12,501,176.00	2.46
258	300725	药石科技	12,497,253.32	2.46
259	002839	张家港行	12,458,716.00	2.45
260	000860	顺鑫农业	12,454,005.10	2.45
261	605009	豪悦护理	12,436,303.82	2.45
262	002567	唐人神	12,427,853.00	2.44
263	600872	中炬高新	12,426,444.00	2.44
264	600100	同方股份	12,404,885.26	2.44
265	688575	亚辉龙	12,395,376.03	2.44
266	000902	新洋丰	12,381,873.00	2.44
267	300767	震安科技	12,357,148.90	2.43
268	002061	浙江交科	12,300,466.32	2.42
269	002351	漫步者	12,295,951.00	2.42
270	688235	百济神州	12,268,140.04	2.41
271	300596	利安隆	12,196,396.00	2.40
272	300319	麦捷科技	12,128,488.00	2.39
273	600389	江山股份	12,116,777.70	2.38
274	002913	奥士康	12,106,760.00	2.38
275	600977	中国电影	12,066,093.00	2.37
276	300439	美康生物	11,997,091.00	2.36
277	301060	兰卫医学	11,981,198.10	2.36
278	603612	索通发展	11,966,062.00	2.35
279	300346	南大光电	11,919,671.58	2.34

280	002130	沃尔核材	11,873,173.20	2.34
281	600710	苏美达	11,762,299.50	2.31
282	002011	盾安环境	11,746,960.50	2.31
283	600933	爱柯迪	11,712,790.00	2.30
284	002993	奥海科技	11,683,583.00	2.30
285	603197	保隆科技	11,653,913.00	2.29
286	300476	胜宏科技	11,641,876.00	2.29
287	300685	艾德生物	11,546,714.94	2.27
288	603533	掌阅科技	11,539,093.00	2.27
289	300224	正海磁材	11,526,431.65	2.27
290	301165	锐捷网络	11,482,099.49	2.26
291	300416	苏试试验	11,468,233.88	2.26
292	300206	理邦仪器	11,445,042.00	2.25
293	601975	招商南油	11,442,047.00	2.25
294	600583	海油工程	11,373,590.00	2.24
295	003009	中天火箭	11,368,481.00	2.24
296	600037	歌华有线	11,314,731.00	2.23
297	002859	洁美科技	11,302,691.00	2.22
298	300438	鹏辉能源	11,297,574.00	2.22
299	000685	中山公用	11,244,018.00	2.21
300	002664	信质集团	11,200,707.00	2.20
301	002489	浙江永强	11,186,856.00	2.20
302	002617	露笑科技	11,139,213.68	2.19
303	002390	信邦制药	11,094,204.00	2.18
304	300379	东方通	11,061,967.00	2.18
305	002048	宁波华翔	11,059,205.00	2.18
306	002428	云南锗业	10,992,849.00	2.16
307	688106	金宏气体	10,952,218.74	2.15
308	601801	皖新传媒	10,926,516.00	2.15
309	600888	新疆众和	10,898,026.00	2.14
310	688700	东威科技	10,855,524.99	2.14
311	300633	开立医疗	10,845,981.00	2.13
312	601311	骆驼股份	10,811,799.00	2.13
313	300133	华策影视	10,811,684.00	2.13
314	000546	金圆股份	10,811,662.00	2.13
315	605369	拱东医疗	10,765,668.40	2.12
316	300693	盛弘股份	10,758,896.20	2.12
317	000543	皖能电力	10,747,598.00	2.11
318	300811	铂科新材	10,730,191.40	2.11
319	000950	重药控股	10,703,412.00	2.11
320	002891	中宠股份	10,699,607.00	2.10
321	002701	奥瑞金	10,693,780.00	2.10
322	600771	广誉远	10,651,300.00	2.10

323	002646	天佑德酒	10,569,458.00	2.08
324	603063	禾望电气	10,544,664.00	2.07
325	000029	深深房 A	10,544,582.70	2.07
326	688559	海目星	10,536,335.91	2.07
327	603583	捷昌驱动	10,479,907.00	2.06
328	000990	诚志股份	10,416,696.88	2.05
329	600742	一汽富维	10,406,202.00	2.05
330	002004	华邦健康	10,379,956.00	2.04
331	605365	立达信	10,375,168.44	2.04
332	002023	海特高新	10,361,745.00	2.04
333	603636	南威软件	10,359,673.00	2.04
334	600649	城投控股	10,324,044.00	2.03
335	000560	我爱我家	10,282,710.00	2.02
336	603129	春风动力	10,267,941.00	2.02
337	002314	南山控股	10,243,057.00	2.01
338	300065	海兰信	10,212,333.00	2.01

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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002597	金禾实业	46,115,638.29	9.07
2	301039	中集车辆	45,326,377.76	8.92
3	603118	共进股份	42,873,703.65	8.43
4	002517	恺英网络	40,136,673.00	7.90
5	002697	红旗连锁	38,849,464.00	7.64
6	300036	超图软件	38,695,505.00	7.61
7	300775	三角防务	38,611,289.64	7.60
8	600285	羚锐制药	38,246,018.04	7.52
9	000758	中色股份	38,072,789.12	7.49
10	600572	康恩贝	37,323,586.00	7.34
11	600797	浙大网新	36,436,881.00	7.17
12	600210	紫江企业	35,626,169.12	7.01
13	300352	北信源	34,464,717.56	6.78
14	600073	上海梅林	34,148,164.00	6.72
15	002463	沪电股份	32,904,296.50	6.47
16	601137	博威合金	32,427,362.00	6.38
17	600420	国药现代	32,397,591.88	6.37
18	002044	美年健康	32,196,718.34	6.33
19	600750	江中药业	31,966,967.66	6.29
20	600211	西藏药业	31,488,087.13	6.19
21	300232	洲明科技	31,340,273.02	6.17
22	002291	遥望科技	30,908,594.14	6.08
23	002139	拓邦股份	30,314,084.52	5.96

24	300226	上海钢联	30,294,984.32	5.96
25	605111	新洁能	29,861,853.84	5.87
26	000917	电广传媒	29,715,973.01	5.85
27	000034	神州数码	29,401,409.88	5.78
28	603368	柳药集团	29,187,766.27	5.74
29	300674	宇信科技	29,166,008.23	5.74
30	002649	博彦科技	28,847,842.13	5.67
31	002237	恒邦股份	28,535,996.06	5.61
32	000933	神火股份	28,391,293.39	5.58
33	300856	科思股份	28,301,935.50	5.57
34	603345	安井食品	28,194,476.41	5.55
35	000612	焦作万方	28,169,681.05	5.54
36	300130	新国都	28,003,575.93	5.51
37	002158	汉钟精机	27,888,568.00	5.49
38	300119	瑞普生物	27,721,948.22	5.45
39	002126	银轮股份	27,484,833.00	5.41
40	002402	和而泰	27,481,707.38	5.41
41	002610	爱康科技	27,448,318.00	5.40
42	600850	电科数字	27,431,164.02	5.40
43	605589	圣泉集团	27,070,048.52	5.33
44	600064	南京高科	26,952,718.00	5.30
45	600158	中体产业	26,541,966.40	5.22
46	600057	厦门象屿	26,540,902.45	5.22
47	000517	荣安地产	26,205,990.28	5.16
48	601908	京运通	26,102,362.80	5.13
49	688556	高测股份	25,970,771.54	5.11
50	300638	广和通	25,939,290.42	5.10
51	002283	天润工业	25,927,867.00	5.10
52	600480	凌云股份	25,875,303.36	5.09
53	300777	中简科技	25,822,206.06	5.08
54	002276	万马股份	25,726,332.15	5.06
55	601375	中原证券	25,525,482.84	5.02
56	300900	广联航空	25,382,184.39	4.99
57	601921	浙版传媒	25,011,342.40	4.92
58	600458	时代新材	24,855,283.67	4.89
59	601126	四方股份	24,853,667.00	4.89
60	600129	太极集团	24,819,411.28	4.88
61	600789	鲁抗医药	24,787,273.20	4.88
62	002605	姚记科技	23,911,617.84	4.70
63	002746	仙坛股份	23,903,082.96	4.70
64	000951	中国重汽	23,702,880.22	4.66
65	600971	恒源煤电	23,658,827.00	4.65
66	605388	均瑶健康	23,649,013.00	4.65

67	301219	腾远钴业	23,561,846.10	4.63
68	000567	海德股份	23,493,336.01	4.62
69	000913	钱江摩托	23,484,847.27	4.62
70	600284	浦东建设	23,260,102.19	4.58
71	002421	达实智能	23,234,534.00	4.57
72	600502	安徽建工	23,219,564.80	4.57
73	000915	华特达因	23,113,058.55	4.55
74	002558	巨人网络	23,106,321.46	4.55
75	002413	雷科防务	23,023,817.35	4.53
76	600531	豫光金铅	23,017,701.79	4.53
77	002174	游族网络	22,940,498.14	4.51
78	600481	双良节能	22,762,228.00	4.48
79	002233	塔牌集团	22,657,807.00	4.46
80	002063	远光软件	22,478,483.31	4.42
81	002611	东方精工	22,355,061.00	4.40
82	002518	科士达	22,088,034.98	4.35
83	002747	埃斯顿	21,901,222.48	4.31
84	000921	海信家电	21,778,858.67	4.28
85	300567	精测电子	21,714,062.00	4.27
86	600612	老凤祥	21,613,387.57	4.25
87	002768	国恩股份	21,592,451.12	4.25
88	002967	广电计量	21,394,285.22	4.21
89	000650	仁和药业	21,393,687.00	4.21
90	002865	钧达股份	21,287,078.58	4.19
91	601567	三星医疗	21,099,754.82	4.15
92	601222	林洋能源	20,958,120.94	4.12
93	600685	中船防务	20,767,730.00	4.09
94	002324	普利特	20,713,073.46	4.07
95	000555	神州信息	20,694,916.80	4.07
96	603979	金诚信	20,657,933.40	4.06
97	002698	博实股份	20,584,947.99	4.05
98	603690	至纯科技	20,571,085.60	4.05
99	603919	金徽酒	20,565,894.10	4.05
100	600587	新华医疗	20,516,234.57	4.04
101	002017	东信和平	20,486,981.00	4.03
102	002851	麦格米特	20,366,645.00	4.01
103	000048	京基智农	20,357,267.58	4.00
104	603027	千禾味业	20,054,309.74	3.94
105	603301	振德医疗	19,932,543.53	3.92
106	000423	东阿阿胶	19,915,235.00	3.92
107	300394	天孚通信	19,810,974.05	3.90
108	002215	诺普信	19,799,956.88	3.89
109	002782	可立克	19,735,256.44	3.88

110	688037	芯源微	19,588,548.53	3.85
111	600761	安徽合力	19,561,037.32	3.85
112	300377	赢时胜	19,404,412.73	3.82
113	002020	京新药业	19,304,752.45	3.80
114	600559	老白干酒	19,271,894.00	3.79
115	002737	葵花药业	19,231,081.06	3.78
116	600267	海正药业	18,950,128.00	3.73
117	600459	贵研铂业	18,838,730.48	3.71
118	002222	福晶科技	18,633,693.85	3.67
119	600483	福能股份	18,525,048.98	3.64
120	688018	乐鑫科技	18,495,366.61	3.64
121	300118	东方日升	18,459,251.40	3.63
122	000928	中钢国际	18,390,035.08	3.62
123	688707	振华新材	18,372,271.83	3.61
124	002895	川恒股份	18,305,291.88	3.60
125	601519	大智慧	18,075,317.00	3.56
126	300973	立高食品	18,039,765.12	3.55
127	600577	精达股份	18,037,863.70	3.55
128	000600	建投能源	17,887,958.00	3.52
129	300502	新易盛	17,882,430.88	3.52
130	000049	德赛电池	17,838,347.07	3.51
131	600557	康缘药业	17,797,173.82	3.50
132	300634	彩讯股份	17,757,916.05	3.49
133	002038	双鹭药业	17,753,265.00	3.49
134	603236	移远通信	17,647,415.50	3.47
135	600120	浙江东方	17,642,781.54	3.47
136	300236	上海新阳	17,576,312.88	3.46
137	600662	外服控股	17,462,507.72	3.44
138	002449	国星光电	17,448,546.98	3.43
139	002706	良信股份	17,221,917.12	3.39
140	002055	得润电子	17,188,540.33	3.38
141	003006	百亚股份	17,095,461.09	3.36
142	002085	万丰奥威	17,065,992.22	3.36
143	600197	伊力特	16,904,143.41	3.33
144	601619	嘉泽新能	16,901,924.00	3.32
145	002036	联创电子	16,885,890.58	3.32
146	000528	柳 工	16,874,212.00	3.32
147	000893	亚钾国际	16,867,895.98	3.32
148	002815	崇达技术	16,731,593.75	3.29
149	300842	帝科股份	16,723,096.00	3.29
150	002456	欧菲光	16,609,248.00	3.27
151	000969	安泰科技	16,489,416.00	3.24
152	600105	永鼎股份	16,470,454.24	3.24

153	300872	天阳科技	16,374,224.74	3.22
154	300773	拉卡拉	16,343,943.00	3.22
155	002979	雷赛智能	16,292,752.35	3.21
156	002335	科华数据	16,268,839.31	3.20
157	688399	硕世生物	16,268,772.02	3.20
158	002446	盛路通信	16,254,318.59	3.20
159	603005	晶方科技	16,196,702.89	3.19
160	002918	蒙娜丽莎	16,174,834.04	3.18
161	600908	无锡银行	16,115,042.00	3.17
162	002662	京威股份	15,992,798.38	3.15
163	300827	上能电气	15,979,641.31	3.14
164	002079	苏州固锔	15,844,810.32	3.12
165	300315	掌趣科技	15,814,895.60	3.11
166	300031	宝通科技	15,766,935.30	3.10
167	300765	新诺威	15,635,218.50	3.08
168	300298	三诺生物	15,595,478.48	3.07
169	601686	友发集团	15,492,220.28	3.05
170	300662	科锐国际	15,408,635.40	3.03
171	300348	长亮科技	15,400,526.65	3.03
172	688277	天智航	15,359,788.00	3.02
173	600748	上实发展	15,218,972.00	2.99
174	688066	航天宏图	15,161,116.17	2.98
175	300303	聚飞光电	15,160,243.00	2.98
176	688516	奥特维	15,141,512.83	2.98
177	300068	南都电源	15,091,540.00	2.97
178	002318	久立特材	15,009,670.00	2.95
179	600312	平高电气	14,990,896.50	2.95
180	600864	哈投股份	14,883,284.00	2.93
181	002212	天融信	14,838,970.00	2.92
182	002100	天康生物	14,810,341.02	2.91
183	300123	亚光科技	14,807,413.00	2.91
184	002106	莱宝高科	14,785,539.00	2.91
185	300855	图南股份	14,765,697.46	2.90
186	300080	易成新能	14,707,669.00	2.89
187	002839	张家港行	14,637,239.00	2.88
188	300762	上海瀚讯	14,617,185.00	2.88
189	600320	振华重工	14,613,435.20	2.87
190	003012	东鹏控股	14,533,222.41	2.86
191	688578	艾力斯	14,493,498.99	2.85
192	300101	振芯科技	14,460,059.64	2.84
193	300109	新开源	14,436,088.36	2.84
194	600266	城建发展	14,426,655.88	2.84
195	000676	智度股份	14,356,856.04	2.82

196	002123	梦网科技	14,268,393.00	2.81
197	002099	海翔药业	14,247,826.00	2.80
198	600742	一汽富维	14,208,440.00	2.80
199	688139	海尔生物	14,130,233.52	2.78
200	300725	药石科技	14,072,136.99	2.77
201	300451	创业慧康	14,019,816.00	2.76
202	603103	横店影视	13,978,919.00	2.75
203	002987	京北方	13,935,899.19	2.74
204	603129	春风动力	13,893,102.00	2.73
205	300803	指南针	13,873,744.34	2.73
206	300382	斯莱克	13,777,974.38	2.71
207	300079	数码视讯	13,637,175.74	2.68
208	002567	唐人神	13,597,672.00	2.67
209	301095	广立微	13,542,530.44	2.66
210	300438	鹏辉能源	13,532,837.00	2.66
211	000860	顺鑫农业	13,472,133.00	2.65
212	000560	我爱我家	13,446,696.94	2.65
213	600776	东方通信	13,446,310.00	2.65
214	002258	利尔化学	13,444,726.94	2.64
215	600370	三房巷	13,429,010.00	2.64
216	603306	华懋科技	13,410,606.00	2.64
217	300002	神州泰岳	13,402,736.56	2.64
218	603466	风语筑	13,394,187.35	2.63
219	002727	一心堂	13,366,963.00	2.63
220	300398	飞凯材料	13,297,383.88	2.62
221	688711	宏微科技	13,284,432.19	2.61
222	688033	天宜上佳	13,281,199.38	2.61
223	300672	国科微	13,020,587.60	2.56
224	603533	掌阅科技	12,951,110.88	2.55
225	605009	豪悦护理	12,931,967.92	2.54
226	002467	二六三	12,862,806.00	2.53
227	000036	华联控股	12,786,494.00	2.52
228	002437	誉衡药业	12,766,710.00	2.51
229	603393	新天然气	12,762,397.80	2.51
230	603920	世运电路	12,752,042.00	2.51
231	002993	奥海科技	12,747,437.00	2.51
232	600821	金开新能	12,735,251.00	2.51
233	600017	日照港	12,716,912.00	2.50
234	603612	索通发展	12,680,209.00	2.49
235	002978	安宁股份	12,676,954.00	2.49
236	000811	冰轮环境	12,635,112.00	2.49
237	002182	宝武镁业	12,621,935.21	2.48
238	688575	亚辉龙	12,612,635.10	2.48

239	000546	金圆股份	12,539,349.00	2.47
240	600490	鹏欣资源	12,501,891.00	2.46
241	600456	宝钛股份	12,461,012.18	2.45
242	603718	海利生物	12,404,392.03	2.44
243	002396	星网锐捷	12,385,501.33	2.44
244	300869	康泰医学	12,374,506.15	2.43
245	300767	震安科技	12,182,161.72	2.40
246	300761	立华股份	12,139,003.00	2.39
247	605168	三人行	12,137,859.56	2.39
248	003009	中天火箭	12,129,868.45	2.39
249	600888	新疆众和	12,091,855.00	2.38
250	603881	数据港	12,001,580.86	2.36
251	300263	隆华科技	11,931,996.00	2.35
252	601975	招商南油	11,920,524.00	2.34
253	688508	芯朋微	11,904,430.48	2.34
254	688559	海目星	11,826,570.31	2.33
255	000902	新洋丰	11,818,417.72	2.32
256	002240	盛新锂能	11,764,107.00	2.31
257	688148	芳源股份	11,682,982.71	2.30
258	002011	盾安环境	11,676,163.00	2.30
259	300639	凯普生物	11,627,811.93	2.29
260	300910	瑞丰新材	11,622,277.20	2.29
261	002984	森麒麟	11,619,740.00	2.29
262	600583	海油工程	11,611,045.00	2.28
263	603323	苏农银行	11,606,269.00	2.28
264	603529	爱玛科技	11,596,996.81	2.28
265	000690	宝新能源	11,543,105.00	2.27
266	600933	爱柯迪	11,482,594.00	2.26
267	300439	美康生物	11,388,809.00	2.24
268	002061	浙江交科	11,351,726.60	2.23
269	603960	克来机电	11,335,468.70	2.23
270	600098	广州发展	11,266,672.00	2.22
271	300596	利安隆	11,247,278.50	2.21
272	002913	奥士康	11,141,805.03	2.19
273	600876	凯盛新能	11,103,162.67	2.18
274	603108	润达医疗	11,091,125.00	2.18
275	600389	江山股份	11,022,519.76	2.17
276	002664	信质集团	10,973,720.11	2.16
277	002006	精工科技	10,962,575.99	2.16
278	002489	浙江永强	10,889,337.54	2.14
279	600639	浦东金桥	10,840,882.00	2.13
280	000685	中山公用	10,799,695.00	2.12
281	002048	宁波华翔	10,795,172.72	2.12

282	600993	马应龙	10,772,346.68	2.12
283	600710	苏美达	10,749,686.75	2.11
284	600977	中国电影	10,675,206.55	2.10
285	300188	国投智能	10,661,965.00	2.10
286	688106	金宏气体	10,648,913.84	2.09
287	603105	芯能科技	10,550,228.00	2.08
288	000950	重药控股	10,518,145.00	2.07
289	000566	海南海药	10,505,830.35	2.07
290	600635	大众公用	10,475,376.00	2.06
291	002617	露笑科技	10,462,224.40	2.06
292	002837	英维克	10,441,856.11	2.05
293	002130	沃尔核材	10,366,972.66	2.04
294	603093	南华期货	10,317,683.00	2.03
295	300602	飞荣达	10,308,147.00	2.03
296	002961	瑞达期货	10,251,865.63	2.02
297	300633	开立医疗	10,178,490.07	2.00
298	002171	楚江新材	10,167,359.00	2.00

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,132,544,494.94
卖出股票收入（成交）总额	8,344,487,285.38

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,174,580.01	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,174,580.01	0.09

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113069	博 23 转债	6,960	696,045.76	0.05
2	127100	神码转债	2,454	245,417.75	0.02
3	127098	欧晶转债	1,436	222,115.68	0.02
4	118046	诺泰转债	110	11,000.82	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

金石资源集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方国税局的处罚。

东北制药集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到辽宁省市场监督管理局的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,224,180.16
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	86,042.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,310,222.30

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
28,867	37,645.84	930,808,257.57	85.65	155,914,145.48	14.35

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	59,767.12	0.005500

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 2 月 6 日）基金份额总额	1,784,551,427.10
本报告期期初基金份额总额	335,576,804.15
本报告期基金总申购份额	937,425,732.34
减：本报告期基金总赎回份额	186,280,133.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,086,722,403.05

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产管理业务部副总经理。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已经连续 6 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 90,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
光大证券股份有限公司	2	2,123,682,588.04	12.17	1,996,654.76	12.22	-
长江证券股份有限公司	1	1,819,032,478.55	10.42	1,699,443.70	10.40	-
华创证券有限责任公司	1	1,792,674,731.07	10.27	1,675,960.14	10.26	-
中信建投证券股份有限公司	2	1,495,362,388.10	8.57	1,402,535.81	8.58	-
西部证券股份有限公司	2	1,316,641,782.53	7.54	1,234,831.64	7.56	-
招商证券股份有限公司	1	1,162,692,452.75	6.66	1,093,560.28	6.69	-
天风证券股份有限公司	1	1,088,228,660.74	6.23	1,013,460.01	6.20	-
东方证券股份有限公司	1	1,008,847,694.23	5.78	944,634.92	5.78	-
中信证券股份有限公司	4	929,205,635.93	5.32	868,887.51	5.32	-
中泰证券股份有限公司	1	803,274,070.48	4.60	748,098.41	4.58	本期报告 退租 1 个
华金证券股份有限公司	2	739,043,410.50	4.23	688,274.73	4.21	-
渤海证券股份有限公司	1	703,158,403.05	4.03	654,859.81	4.01	-
广发证券股份有限公司	1	545,434,418.31	3.13	512,750.21	3.14	-
中国国际金	1	387,399,409.70	2.22	366,440.61	2.24	-

融股份有限 公司						
国信证券股 份有限公司	2	375,065,221.79	2.15	349,301.26	2.14	-
东北证券股 份有限公司	1	330,364,589.99	1.89	307,672.42	1.88	-
国投证券股 份有限公司	1	263,105,969.01	1.51	248,453.81	1.52	-
湘财证券责 任有限公司	2	260,020,388.81	1.49	245,953.50	1.51	本期报告 新增 2 个
国泰君安证 券股份有限 公司	1	140,004,387.44	0.80	130,385.13	0.80	-
方正证券股 份有限公司	1	79,800,328.68	0.46	74,320.88	0.45	-
长城证券股 份有限公司	2	54,301,490.41	0.31	50,990.59	0.31	-
东方财富证 券股份有限 公司	2	36,372,257.69	0.21	33,876.60	0.21	-
汇丰前海证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

券经营机构签订协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
光大证券股份有限公司	87,073.80	0.96	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1,340.56	0.01	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	993,666.15	10.98	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	972,736.20	10.74	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	159,662.79	1.76	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	821,573.98	9.08	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	210,826.57	2.33	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	2,768,311.91	30.58	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	419,302.54	4.63	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	2,140,149.50	23.64	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券责任有	-	-	-	-	-	-

限公司						
国泰君安证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有 限公司	478,275.71	5.28	-	-	-	-
长城证券股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 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基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
2	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
3	关于旗下部分基金新增平安银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 3 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 10 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 24 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 25 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
8	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
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	2023 年 4 月 8 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 18 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
12	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 22 日

14	关于旗下部分基金新增中国光大银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 28 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 6 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 13 日
17	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 26 日
18	景顺长城量化小盘股票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	2023 年 5 月 26 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增德邦证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 26 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 27 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 10 日
22	关于旗下部分基金新增杭州银行股份有限公司杭 e 家平台为销售平台并开通基金转换业务及参加申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 16 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 17 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增开源证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 20 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 22 日
26	关于景顺长城量化小盘股票型证券投资基金暂停接受伍佰万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 27 日
27	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 27 日
28	关于景顺长城量化小盘股票型证券投资基金恢复接受伍佰万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 29 日
29	景顺长城基金管理有限公司 2022 年度环境信息披露报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 30 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2023 年 7 月 1 日

	停机维护的公告	网站	
31	关于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	2023 年 7 月 1 日
32	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 7 月 8 日
33	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 7 月 15 日
34	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 7 月 21 日
35	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 7 月 21 日
36	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在腾安基金销售（深圳）有限公司开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 2 日
37	景顺长城量化小盘股票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	2023 年 8 月 18 日
38	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 18 日
39	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 18 日
40	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金托管协议（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 18 日
41	景顺长城基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 18 日
42	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 30 日
43	景顺长城基金管理有限公司关于终止南京途牛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	2023 年 8 月 30 日
44	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 30 日
45	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 2 日
46	景顺长城基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）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	2023 年 9 月 4 日
47	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 22 日
48	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 14 日
49	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 25 日

50	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 25 日
51	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 2 日
52	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 25 日
53	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 9 日
54	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 16 日
55	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 23 日
56	关于景顺长城量化小盘股票型证券投资基金暂停接受伍佰万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 27 日
57	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 27 日
58	关于景顺长城量化小盘股票型证券投资基金恢复接受伍佰万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 29 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20230526-20231231	0.00	376,538,426.01	22,733,134.86	353,805,291.15	32.56
	2	20230101-20230119	70,406,087.12	23,668,047.33	0.00	94,074,134.45	8.66
	3	20230131-20231231	0.00	376,402,379.21	0.00	376,402,379.21	34.64
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>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。</p> <p>2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：</p> <p>（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；</p> <p>（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</p>							

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与本基金的基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2023 年 8 月 22 日起，调低本基金的管理费率和托管费率并对基金合同有关条款进行修订。详情请参阅本基金管理人于 2023 年 8 月 18 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城量化小盘股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 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 3 月 29 日