

景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 盈利投资者数量占比	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	54
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金	
基金简称	景顺长城红利量化选股股票	
基金主代码	022344	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 1 月 24 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	14,369,026.74 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	景顺长城红利量化选股股票 A	景顺长城红利量化选股股票 C
下属分级基金的交 易代码	022344	022345
报告期末下属分级 基金的份额总额	6,832,214.54 份	7,536,812.20 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过量化模型精选符合红利主题的股票，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	（一）资产配置策略 本基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况进行调整，并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例，使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上优化投资组合。 （二）股票投资策略 1、红利主题的界定 本基金重点投资于分红较为稳定、股息率较高的上市公司，本基金所定义的红利主题相关股票是指满足以下前两项中任一项且同时满足第三项特征的股票：（1）中证红利指数成份股和备选成份股；（2）过去三年连续现金分红，且股息率（现金分红/市值）处于市场中股息率较高的前 50%；（3）经营状况良好、无重大违法违规事项的非 ST 及非*ST 股票。 2、量化投资策略 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，优选个股产出投资组合。 该模型通过构建多因子量化系统，综合评估成长、创新、估值、市场趋势、盈利、企业质量、投资者情绪等多个因素，以自下而上为主，自上而下为辅，分辨各类资产和各证券之间的定价偏差。

	超额收益模型是一个多因子打分系统，分别从不同维度刻画个股的潜在收益，主要包括：成长因子、创新因子、估值因子、盈利质量因子、动量因子、情绪因子。 风险模型：该模型控制投资组合对各类风险因子的敞口，包括基金规模、资产波动率、行业集中度等，力求主动风险以及跟踪误差控制在目标范围内。 成本模型：该模型根据各类资产的市场交易活跃度、市场冲击成本、印花税、佣金等数据预测本基金的交易成本，能有效控制基金的换手率。 （三）存托凭证投资策略 本基金的存托凭证投资将根据本基金的投资目标和上述股票投资策略进行筛选。 （四）债券投资策略 债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。 （五）股指期货投资策略 本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。 （六）国债期货投资策略 本基金可投资国债期货，本基金投资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。 （七）股票期权投资策略 本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。 （八）资产支持证券投资策略 本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。 （九）参与融资业务的投资策略 本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，对冲系统性风险，实现保值和锁定收益。 （十）信用衍生品投资策略 本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。同时，本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构
--	---

	的风险管理，合理分散交易对手方、创设机构的集中度，对交易对手方、创设机构的财务状况、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。
业绩比较基准	中证红利指数收益率 $\times 90\%$ + 人民币活期存款利率(税后) $\times 10\%$
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和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	交通银行股份有限公司
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
客户服务电话	4008888606	95559
传真	0755-22381339	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518048	200336
法定代表人	叶才	任德奇

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	景顺长城红利量化选股股票 A	景顺长城红利量化选股股票 C
本期已实现收益	328,062.68	358,625.97
本期利润	-314,051.40	-339,189.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0437	-0.0408
本期加权平均净值利润率	-3.84%	-3.60%

本期基金份额净值增长率	-4.37%	-4.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	308,005.29	295,063.77
期末可供分配基金份额利润	0.0451	0.0391
期末基金资产净值	7,140,219.83	7,831,875.97
期末基金份额净值	1.0450	1.0391
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	4.50%	3.91%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城红利量化选股股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-7.72%	0.82%	-11.13%	0.83%	3.41%	-0.01%
过去六个月	-4.37%	0.87%	-7.85%	0.89%	3.48%	-0.02%
过去一年	0.58%	0.72%	-6.37%	0.74%	6.95%	-0.02%
自基金合同生效起至今	4.50%	0.75%	-4.51%	0.75%	9.01%	0.00%

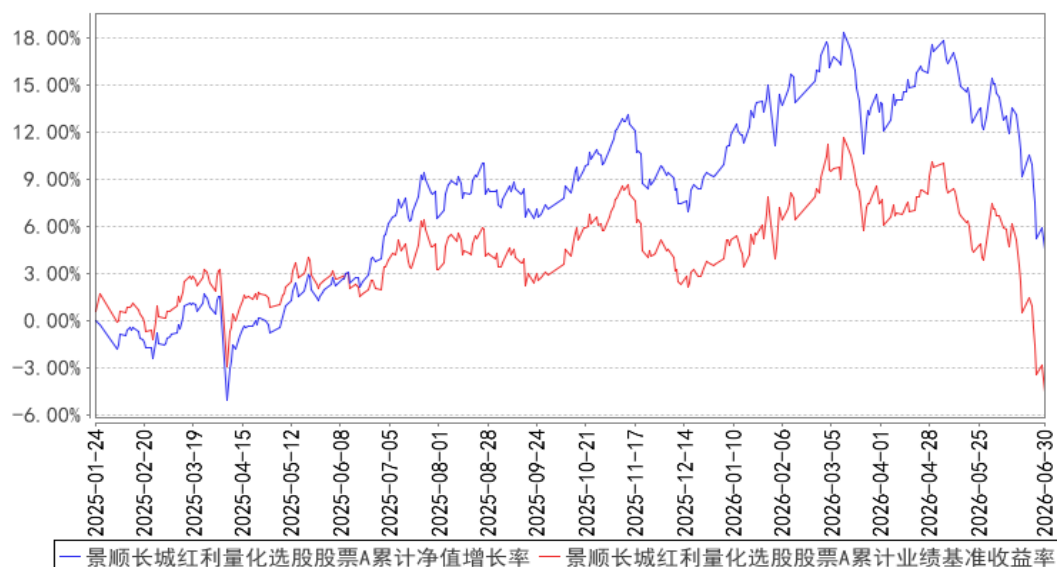
景顺长城红利量化选股股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-7.81%	0.82%	-11.13%	0.83%	3.32%	-0.01%

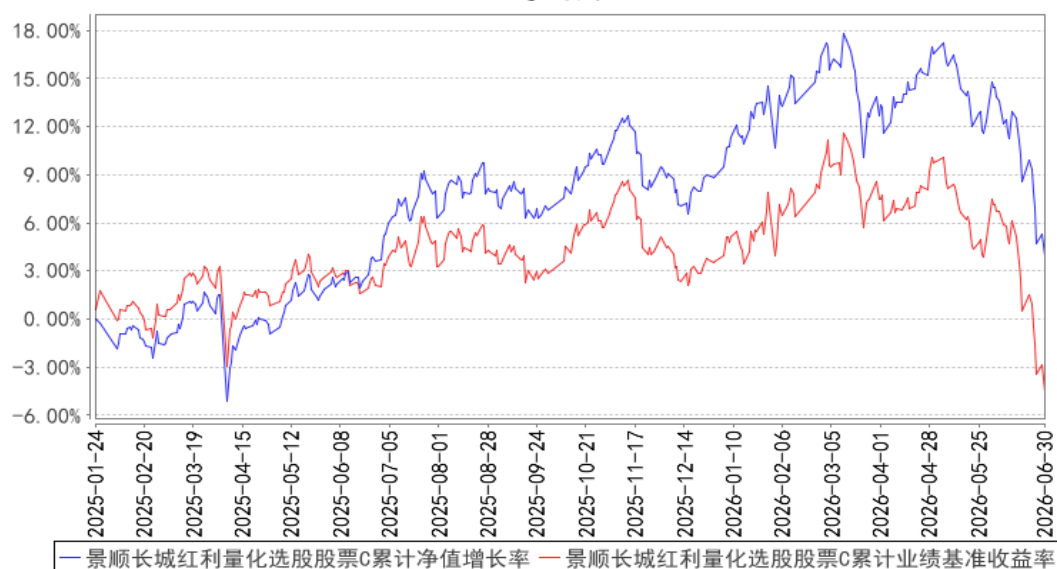
过去六个月	-4.56%	0.87%	-7.85%	0.89%	3.29%	-0.02%
过去一年	0.18%	0.72%	-6.37%	0.74%	6.55%	-0.02%
自基金合同生效起至今	3.91%	0.75%	-4.51%	0.75%	8.42%	0.00%

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

景顺长城红利量化选股股票A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城红利量化选股股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 80%-95%；投资于本基金界定的红利主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。股指

期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自 2025 年 1 月 24 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。报告期末距离建仓结束期末满一年。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2026 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 233 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	2025 年 1 月 24 日	-	23 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 23 年证券、基金行业从业经验。
徐喻军	本基金的基金经理	2025 年 1 月 24 日	-	16 年	理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，

					担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员，自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 16 年证券、基金行业从业经验。
王 高 斌	本基金的 基金助理	2025 年 3 月 27 日	-	8 年	经济学硕士。2018 年 7 月加入本公司，担任量化及指数投资部研究员，现任量化及指数投资部基金经理助理。具有 8 年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为公司决定且公告的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”及“离任日期”指根据公司决定且公告的聘任、解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城红利量化选股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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 10 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

2026 年上半年，国内宏观经济延续稳中有进的发展态势，生产端保持较强韧性，价格端出现积极变化，结构性亮点持续涌现。从数据来看，2026 年 4-6 月国内制造业 PMI 依次为 50.3、50.0、50.3，制造业景气水平连续四个月运行在临界点及以上，6 月产需两端同步改善，市场需求有所回暖。上半年国内生产总值同比增长 4.7%，经济运行在合理区间。上半年规模以上工业增加值同比增长 5.4%，其中装备制造业、高技术制造业增加值分别增长 9.3%、13.3%，均明显快于全部规模以上工业，新动能培育成效持续显现。企业效益持续恢复，上半年全国规模以上工业企业利润同比增长 18.7%，营业收入利润率同比提高 0.59 个百分点，其中高技术制造业、有色金属等行业利润增长较快，引领作用明显。价格端出现积极变化，上半年 CPI 同比上涨 1.0%，其中 6 月 CPI 同比上涨 1.0%，扣除食品和能源价格的核心 CPI 同比上涨 1.0%，物价保持温和上涨；上半年 PPI 同比上涨 1.5%，实现由负转正（一季度为同比下降 0.6%），其中高技术制造业、有色金属等行业价格上涨较为明显，工业品价格改善的积极信号不断增多。货币金融环境保持稳健，6 月末 M2 同比增长 8.0%，M1 同比增长 4.0%，M2 增速继续高于名义经济增速，为经济发展营造了适宜的货币金融环境。6 月末外汇储备 34163 亿美元，连续第三个月维持在 3.4 万亿美元以上，总体保持基本稳定，人民币汇率整体平稳运行。整体来看，上半年国内经济运行在合理区间，工业企业盈利改善、工业品价格回升、新动能快速成长等积极因素不断累积，经济内生动能逐步增强。上半年 A 股市场整体上行，结构分化较为明显，上证综指上涨 3.16%，沪深 300 指数上涨 7.55%，创业板指上涨 35.58%，市场呈现出较为明显的成长风格占优特征。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-4.37%，业绩比较基准收益率为-7.85%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为-4.56%，业绩比较基准收益率为-7.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，宏观政策或将继续围绕扩大内需、促进科技创新、推动产业升级等重点方向持续发力。“十五五”规划开局之年的各项政策部署有望加快落地，“两新”政策（大规模设备更新和消费品以旧换新）持续显效，内需对经济增长的支撑作用有望进一步增强。货币政策保持适度宽松的基调，流动性环境总体有利。工业品价格的回升有望改善企业盈利预期，为权益市场提供基本面支撑。外部环境方面，海外主要经济体货币政策走向、国际经贸形势变化以及地缘不确定性因素仍需密切关注。同时，随着经济动能的持续转换，以人工智能、新能源、高端装备为代表的新的质生产力相关产业有望延续较高景气度，权益市场仍具有较多结构性投资机会。个股层面相对

充裕的流动性环境、市场层面结构性分化的行情特征，对于量化选股模型而言是相对有利的环境。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 股市场整体估值处于合理区间，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。

本基金是以高股息股票为主要投资范围的主动量化基金，我们的投资组合主要以基本面量化选股为主，风格上维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生持续稳定的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。基金估值委员会的成员包括投资部、研究部/固定收益部信评人员、基金事务部、法律监察稽核部、风险管理部等相关人员。本基金托管人根据基金合同及法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

从 2025 年 7 月 4 日至 2026 年 6 月 30 日，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。本基金管理人已按照基金合同要求向中国证监会报告解决方案。

同时为减轻迷你基金固定费用支出给投资者造成的负担，切实保障基金份额持有人利益，自 2025 年 9 月 26 日起至本报告期末，我司承担本基金的固定费用（包括信息披露费、审计费等）。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，景顺长城基金管理有限公司在景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由景顺长城基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,324,500.73	3,943,889.59
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	13,760,769.30	15,375,924.00
其中：股票投资		13,760,769.30	15,375,924.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		9,080.36	4,465.68

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		15,094,350.39	19,324,279.27
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		100,474.79	2,251,619.33
应付管理人报酬		16,058.41	22,175.76
应付托管费		2,676.39	3,695.97
应付销售服务费		2,796.09	4,639.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	248.91	96,787.21
负债合计		122,254.59	2,378,917.68
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	14,369,026.74	15,536,931.45
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	603,069.06	1,408,430.14
净资产合计		14,972,095.80	16,945,361.59
负债和净资产总计		15,094,350.39	19,324,279.27

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 14,369,026.74 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.0450 元，基金份额 6,832,214.54 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.0391 元，基金份额 7,536,812.20 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 24 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-511,630.67	3,921,861.46
1. 利息收入		1,884.65	28,804.05
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,884.65	28,804.05

债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		814,975.54	3,310,016.25
其中：股票投资收益	6.4.7.14	544,757.40	2,311,267.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	0.12
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	270,218.14	998,748.32
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,339,929.79	450,673.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	11,438.93	132,367.88
减：二、营业总支出		141,610.47	884,476.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	104,656.95	574,325.69
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	17,442.81	95,720.88
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	18,651.93	139,766.76
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	858.78	74,663.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-653,241.14	3,037,384.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-653,241.14	3,037,384.83
五、其他综合收益的税后		-	-

净额			
六、综合收益总额		-653,241.14	3,037,384.83

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	15,536,931.45	-	1,408,430.14	16,945,361.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	15,536,931.45	-	1,408,430.14	16,945,361.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,167,904.71	-	-805,361.08	-1,973,265.79
（一）、综合收益总额	-	-	-653,241.14	-653,241.14
（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）	-1,167,904.71	-	-152,119.94	-1,320,024.65
其中：1. 基金申购款	7,493,756.38	-	1,029,921.44	8,523,677.82
2. 基金赎回款	-8,661,661.09	-	-1,182,041.38	-9,843,702.47
（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	14,369,026.74	-	603,069.06	14,972,095.80

资产				
项目	上年度可比期间			
	2025 年 1 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	213,719,789.28	-	-	213,719,789.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-163,292,677.09	-	1,902,898.82	-161,389,778.27
（一）、综合收益总额	-	-	3,037,384.83	3,037,384.83
（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）	-163,292,677.09	-	-1,134,486.01	-164,427,163.10
其中：1. 基金申购款	32,909,425.03	-	736,078.09	33,645,503.12
2. 基金赎回款	-196,202,102.12	-	-1,870,564.10	-198,072,666.22
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	50,427,112.19	-	1,902,898.82	52,330,011.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]1342 号文《关于准予景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金注册的批复》，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《景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，经向中国证监会备案，基金合同于 2025 年 1 月 24 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金募集期间为 2024 年 12 月 16 日至 2025 年 1 月 22 日，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 213,605,767.43 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 114,021.85 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 213,719,789.28 元，折合 213,719,789.28 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2025）验字第 70015711_H02 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金初始基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金可以根据法律法规的规定参与融资业务。

本基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 80%-95%；投资于本基金界定的红利主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本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 2026 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，

按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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

（2）企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《财政部 国家税务总局 证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《财政部 国家税务总局 证监

会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自 2015 年 9 月 8 日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

(4) 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3‰调整为 1‰,自 2008 年 9 月 19 日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;根据财政部、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》的规定,自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题,根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《财政部 国家税务总局 证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	903,089.56
等于: 本金	903,006.23
加: 应计利息	83.33
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	-
存款期限 3 个月(含)至 1 年	-
存款期限 1 年(含)以上	-
其他存款	421,411.17
等于: 本金	421,404.58
加: 应计利息	6.59
减: 坏账准备	-
合计	1,324,500.73

注：其他存款为存放在证券经纪商经纪专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	15,044,927.39	-	13,760,769.30	-1,284,158.09
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	15,044,927.39	-	13,760,769.30	-1,284,158.09

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	40.91
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他	208.00
合计	248.91

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城红利量化选股股票 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,428,208.60	7,428,208.60
本期申购	2,325,630.13	2,325,630.13
本期赎回（以“-”号填列）	-2,921,624.19	-2,921,624.19
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	6,832,214.54	6,832,214.54

景顺长城红利量化选股股票 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,108,722.85	8,108,722.85
本期申购	5,168,126.25	5,168,126.25
本期赎回（以“-”号填列）	-5,740,036.90	-5,740,036.90
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	7,536,812.20	7,536,812.20

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城红利量化选股股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	905,758.70	-216,702.14	689,056.56
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	905,758.70	-216,702.14	689,056.56
本期利润	328,062.68	-642,114.08	-314,051.40
本期基金份额交易产生的变动数	-94,841.31	27,841.44	-66,999.87
其中：基金申购款	374,179.76	-31,901.98	342,277.78
基金赎回款	-469,021.07	59,743.42	-409,277.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,138,980.07	-830,974.78	308,005.29

景顺长城红利量化选股股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	955,390.80	-236,017.22	719,373.58
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	955,390.80	-236,017.22	719,373.58
本期利润	358,625.97	-697,815.71	-339,189.74
本期基金份额交易产生的变动数	-106,815.46	21,695.39	-85,120.07
其中：基金申购款	777,019.67	-89,376.01	687,643.66
基金赎回款	-883,835.13	111,071.40	-772,763.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,207,201.31	-912,137.54	295,063.77

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,700.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	183.59
结算备付金利息收入	-
其他	0.64
合计	1,884.65

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	544,757.40
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	544,757.40

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	58,407,533.08
减：卖出股票成本总额	57,773,476.09
减：交易费用	89,299.59
买卖股票差价收入	544,757.40

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	270,218.14
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	270,218.14

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,339,929.79
股票投资	-1,339,929.79

债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,339,929.79

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	7,880.83
基金转换费收入	3,558.10
合计	11,438.93

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	858.78
合计	858.78

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	104,656.95	574,325.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	47,477.87	256,309.25
应支付基金管理人的净管理费	57,179.08	318,016.44

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	17,442.81	95,720.88

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，

按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城红利量化选股股票 A	景顺长城红利量化选股股票 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	1,522.37	1,522.37
交通银行	-	6,135.33	6,135.33
长城证券	-	-	-
合计	-	7,657.70	7,657.70
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城红利量化选股股票 A	景顺长城红利量化选股股票 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	3,164.73	3,164.73
交通银行	-	93,084.78	93,084.78
长城证券	-	-	-
合计	-	96,249.51	96,249.51

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期	903,089.56	1,700.42	5,822,259.47	21,904.66

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或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一

方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,324,500.73	-	-	-	-	-	1,324,500.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	13,760,769.30	13,760,769.30
应收申购款	-	-	-	-	-	9,080.36	9,080.36
资产总计	1,324,500.73	-	-	-	-	13,769,849.66	15,094,350.39
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	100,474.79	100,474.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	16,058.41	16,058.41
应付托管费	-	-	-	-	-	2,676.39	2,676.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,796.09	2,796.09
其他负债	-	-	-	-	-	248.91	248.91
负债总计	-	-	-	-	-	122,254.59	122,254.59
利率敏感度缺口	1,324,500.73	-	-	-	-	-	-
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	3,943,889.59	-	-	-	-	-	3,943,889.59
交易性金融资产	-	-	-	-	-	15,375,924.00	15,375,924.00
应收申购款	-	-	-	-	-	4,465.68	4,465.68
资产总计	3,943,889.59	-	-	-	-	15,380,389.68	19,324,279.27
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,251,619.33	2,251,619.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	22,175.76	22,175.76
应付托管费	-	-	-	-	-	3,695.97	3,695.97

应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,639.41	4,639.41
其他负债	-	-	-	-	-	96,787.21	96,787.21
负债总计	-	-	-	-	-	2,378,917.68	2,378,917.68
利率敏感度缺口	3,943,889.59	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	13,760,769.30	91.91	15,375,924.00	90.74
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	13,760,769.30	91.91	15,375,924.00	90.74

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	207,078.51	243,097.84
	沪深 300 指数下降 5%	-207,078.51	-243,097.84

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	13,760,769.30	15,356,915.00
第二层次	-	19,009.00
第三层次	-	-
合计	13,760,769.30	15,375,924.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	13,760,769.30	91.17
	其中：股票	13,760,769.30	91.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,324,500.73	8.77
8	其他各项资产	9,080.36	0.06
9	合计	15,094,350.39	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	67,617.70	0.45
B	采矿业	2,741,798.00	18.31
C	制造业	5,028,324.00	33.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	337,772.00	2.26
E	建筑业	282,168.00	1.88
F	批发和零售业	221,353.00	1.48
G	交通运输、仓储和邮政业	1,157,023.00	7.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	141,844.00	0.95

J	金融业	2,805,176.00	18.74
K	房地产业	150,500.00	1.01
L	租赁和商务服务业	378,388.00	2.53
M	科学研究和技术服务业	126,985.60	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	114,404.00	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	13,740.00	0.09
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	193,676.00	1.29
S	综合	-	-
	合计	13,760,769.30	91.91

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601919	中远海控	21,900	290,394.00	1.94
2	601699	潞安环能	16,500	235,620.00	1.57
3	000672	上峰材料	9,600	227,328.00	1.52
4	000933	神火股份	10,600	224,720.00	1.50
5	600188	兖矿能源	12,600	223,902.00	1.50
6	000983	山西焦煤	34,800	201,840.00	1.35
7	600546	山煤国际	17,400	190,182.00	1.27
8	601666	平煤股份	26,400	188,760.00	1.26
9	601009	南京银行	17,500	173,075.00	1.16
10	601001	晋控煤业	9,900	172,161.00	1.15
11	600919	江苏银行	15,800	170,324.00	1.14
12	601988	中国银行	28,600	163,592.00	1.09
13	601187	厦门银行	23,800	162,554.00	1.09
14	600015	华夏银行	24,600	157,194.00	1.05
15	601997	贵阳银行	30,100	154,413.00	1.03
16	600177	雅戈尔	19,800	149,094.00	1.00
17	601077	渝农商行	24,100	147,251.00	0.98
18	002154	报喜鸟	40,300	143,468.00	0.96
19	600985	淮北矿业	10,100	141,905.00	0.95
20	600153	建发股份	17,800	141,154.00	0.94
21	600295	鄂尔多斯	13,100	140,432.00	0.94
22	000408	藏格矿业	2,000	138,640.00	0.93
23	601101	昊华能源	13,100	138,336.00	0.92
24	603565	中谷物流	14,000	137,340.00	0.92
25	601998	中信银行	19,800	137,214.00	0.92

26	600489	中金黄金	7,400	133,570.00	0.89
27	601168	西部矿业	4,900	132,986.00	0.89
28	601225	陕西煤业	6,500	132,275.00	0.88
29	601288	农业银行	20,500	124,435.00	0.83
30	600256	广汇能源	25,100	123,994.00	0.83
31	600282	南钢股份	27,000	123,930.00	0.83
32	601398	工商银行	17,400	123,018.00	0.82
33	002043	兔宝宝	10,800	119,664.00	0.80
34	600741	华域汽车	7,400	114,848.00	0.77
35	601229	上海银行	13,200	114,576.00	0.77
36	600064	南京高科	15,600	111,228.00	0.74
37	000807	云铝股份	5,000	110,700.00	0.74
38	600971	恒源煤电	15,900	109,710.00	0.73
39	601000	唐山港	25,600	106,240.00	0.71
40	601658	邮储银行	21,400	105,502.00	0.70
41	601088	中国神华	2,600	101,504.00	0.68
42	601857	中国石油	11,500	99,820.00	0.67
43	600028	中国石化	22,300	99,458.00	0.66
44	601963	重庆银行	9,700	97,776.00	0.65
45	002563	森马服饰	19,000	95,760.00	0.64
46	603706	东方环宇	5,400	93,366.00	0.62
47	601166	兴业银行	5,600	92,736.00	0.62
48	600757	长江传媒	12,500	91,375.00	0.61
49	002532	天山铝业	8,400	90,132.00	0.60
50	601916	浙商银行	33,100	87,053.00	0.58
51	600348	华阳股份	11,200	85,680.00	0.57
52	600012	皖通高速	5,400	85,104.00	0.57
53	002756	永兴材料	1,500	84,960.00	0.57
54	600499	科达制造	6,100	84,180.00	0.56
55	601939	建设银行	8,700	83,781.00	0.56
56	600901	江苏金租	14,300	82,225.00	0.55
57	000783	长江证券	8,300	80,925.00	0.54
58	000429	粤高速 A	5,900	80,535.00	0.54
59	600502	安徽建工	18,400	80,040.00	0.53
60	600398	海澜之家	15,300	80,019.00	0.53
61	002416	爱施德	8,800	78,848.00	0.53
62	600755	厦门国贸	14,500	78,590.00	0.52
63	601825	沪农商行	10,400	77,896.00	0.52
64	000776	广发证券	3,300	77,220.00	0.52
65	600801	华新建材	4,900	76,440.00	0.51
66	600057	厦门象屿	14,100	76,422.00	0.51
67	002948	青岛银行	14,900	75,692.00	0.51
68	603967	中创物流	7,300	75,555.00	0.50

69	000651	格力电器	2,000	75,000.00	0.50
70	600039	四川路桥	9,000	70,380.00	0.47
71	002233	塔牌集团	9,100	63,427.00	0.42
72	002315	焦点科技	2,500	58,200.00	0.39
73	002601	龙佰集团	3,500	57,680.00	0.39
74	600036	招商银行	1,600	56,800.00	0.38
75	603995	甬金股份	2,400	55,704.00	0.37
76	601006	大秦铁路	11,800	54,398.00	0.36
77	600938	中国海油	2,000	54,300.00	0.36
78	603187	海容冷链	4,700	54,003.00	0.36
79	603966	法兰泰克	6,320	51,508.00	0.34
80	601818	光大银行	17,800	51,442.00	0.34
81	601838	成都银行	2,900	51,330.00	0.34
82	600251	冠农股份	5,800	50,112.00	0.33
83	002772	众兴菌业	4,300	48,848.00	0.33
84	600350	山东高速	4,300	47,859.00	0.32
85	601216	君正集团	10,500	46,830.00	0.31
86	600096	云天化	1,500	45,600.00	0.30
87	000589	贵州轮胎	11,200	45,472.00	0.30
88	600123	兰花科创	8,300	44,322.00	0.30
89	000090	天健集团	14,300	43,043.00	0.29
90	605088	冠盛股份	1,500	42,270.00	0.28
91	601169	北京银行	8,500	41,650.00	0.28
92	002540	亚太科技	8,900	41,563.00	0.28
93	002415	海康威视	1,200	41,040.00	0.27
94	600233	圆通速递	2,600	40,950.00	0.27
95	603588	高能环境	2,100	40,320.00	0.27
96	601598	中国外运	7,900	39,184.00	0.26
97	301219	腾远钴业	710	38,908.00	0.26
98	688131	皓元医药	400	37,840.00	0.25
99	000425	徐工机械	4,600	37,214.00	0.25
100	603518	锦泓集团	5,100	36,465.00	0.24
101	600496	精工钢构	11,600	35,960.00	0.24
102	600729	重百集团	1,900	35,682.00	0.24
103	603223	恒通股份	2,700	35,235.00	0.24
104	002572	索菲亚	4,800	35,040.00	0.23
105	600710	苏美达	3,400	32,504.00	0.22
106	301109	军信股份	2,600	32,396.00	0.22
107	688202	美迪西	400	32,284.00	0.22
108	002249	大洋电机	4,200	31,500.00	0.21
109	000157	中联重科	4,500	31,365.00	0.21
110	000404	长虹华意	3,900	30,654.00	0.20
111	002128	电投能源	1,300	30,056.00	0.20

112	600997	开滦股份	6,200	29,450.00	0.20
113	601668	中国建筑	6,700	29,078.00	0.19
114	601318	中国平安	600	28,644.00	0.19
115	601098	中南传媒	2,900	28,536.00	0.19
116	002737	葵花药业	2,500	28,025.00	0.19
117	600641	先导基电	700	27,902.00	0.19
118	002824	和胜股份	800	27,664.00	0.18
119	600323	瀚蓝环境	1,000	27,460.00	0.18
120	603648	畅联股份	3,200	27,456.00	0.18
121	000951	中国重汽	1,400	27,314.00	0.18
122	002206	海利得	5,100	26,367.00	0.18
123	002372	伟星新材	3,200	26,208.00	0.18
124	600016	民生银行	8,100	26,082.00	0.17
125	600373	中文传媒	3,900	25,857.00	0.17
126	001359	平安电工	200	25,050.00	0.17
127	601717	中创智领	1,800	25,038.00	0.17
128	600419	天润乳业	3,300	24,981.00	0.17
129	002867	周大生	2,200	24,530.00	0.16
130	603886	元祖股份	1,900	24,282.00	0.16
131	601928	凤凰传媒	2,700	23,733.00	0.16
132	000869	张裕A	1,500	23,370.00	0.16
133	601518	吉林高速	8,200	22,960.00	0.15
134	000895	双汇发展	1,000	22,400.00	0.15
135	300898	熊猫乳品	1,200	21,744.00	0.15
136	603100	川仪股份	1,200	21,660.00	0.14
137	002236	大华股份	1,300	21,437.00	0.14
138	601117	中国化学	2,900	21,315.00	0.14
139	002515	金字火腿	2,100	21,021.00	0.14
140	600737	中粮糖业	1,700	20,961.00	0.14
141	600461	洪城环境	2,300	20,838.00	0.14
142	601058	赛轮轮胎	1,800	20,754.00	0.14
143	603619	中曼石油	1,100	20,581.00	0.14
144	002727	一心堂	2,100	20,139.00	0.13
145	603816	顾家家居	900	20,124.00	0.13
146	603057	紫燕食品	900	20,070.00	0.13
147	600269	赣粤高速	5,000	19,900.00	0.13
148	605111	新洁能	200	19,828.00	0.13
149	600026	中远海能	1,100	19,734.00	0.13
150	600285	羚锐制药	1,000	19,380.00	0.13
151	688800	瑞可达	200	19,194.00	0.13
152	603124	江南新材	100	18,698.00	0.12
153	603600	永艺股份	2,100	18,627.00	0.12
154	300566	激智科技	500	18,475.00	0.12

155	002661	克明食品	2,600	18,018.00	0.12
156	002612	朗姿股份	1,600	17,936.00	0.12
157	601156	东航物流	1,100	17,732.00	0.12
158	600008	首创环保	6,500	17,680.00	0.12
159	601899	紫金矿业	700	17,598.00	0.12
160	002701	奥瑞金	4,100	17,466.00	0.12
161	600183	生益科技	100	17,340.00	0.12
162	003010	若羽臣	700	17,010.00	0.11
163	002270	华明装备	900	16,965.00	0.11
164	600352	浙江龙盛	1,400	16,954.00	0.11
165	300745	欣锐科技	400	16,888.00	0.11
166	002245	蔚蓝锂芯	900	16,839.00	0.11
167	300408	三环集团	100	16,690.00	0.11
168	002832	比音勒芬	800	16,512.00	0.11
169	601211	国泰海通	900	16,380.00	0.11
170	300938	信测标准	320	15,961.60	0.11
171	000623	吉林敖东	900	15,957.00	0.11
172	002837	英维克	200	15,912.00	0.11
173	300005	探路者	700	15,820.00	0.11
174	300373	扬杰科技	100	15,723.00	0.11
175	300586	美联新材	1,000	15,640.00	0.10
176	002027	分众传媒	3,200	15,488.00	0.10
177	300951	博硕科技	300	15,150.00	0.10
178	603699	纽威股份	300	15,090.00	0.10
179	002810	山东赫达	600	14,820.00	0.10
180	002138	顺络电子	200	14,620.00	0.10
181	688046	药康生物	600	14,520.00	0.10
182	603998	方盛制药	1,600	14,448.00	0.10
183	300073	当升科技	300	14,412.00	0.10
184	601019	山东出版	2,200	14,080.00	0.09
185	000848	承德露露	1,900	14,060.00	0.09
186	301061	匠心家居	400	14,028.00	0.09
187	300529	健帆生物	900	13,860.00	0.09
188	688248	南网科技	200	13,836.00	0.09
189	688589	力合微	600	13,788.00	0.09
190	300492	华图山鼎	400	13,740.00	0.09
191	000572	海马汽车	3,700	13,690.00	0.09
192	601886	江河集团	1,700	13,651.00	0.09
193	601339	百隆东方	2,000	13,540.00	0.09
194	300772	运达股份	1,100	13,530.00	0.09
195	300623	捷捷微电	300	13,497.00	0.09
196	688173	希荻微	700	13,398.00	0.09
197	002847	盐津铺子	300	13,380.00	0.09

198	002483	润邦股份	2,700	13,338.00	0.09
199	002379	宏桥控股	900	13,293.00	0.09
200	688388	嘉元科技	300	13,200.00	0.09
201	603299	苏盐井神	1,500	13,185.00	0.09
202	000600	建投能源	1,500	13,125.00	0.09
203	003006	百亚股份	900	13,059.00	0.09
204	601139	深圳燃气	2,300	13,018.00	0.09
205	601619	嘉泽新能	3,000	12,900.00	0.09
206	600509	天富能源	1,500	12,675.00	0.08
207	688097	博众精工	200	12,610.00	0.08
208	002083	孚日股份	1,200	12,588.00	0.08
209	301127	武汉天源	600	12,432.00	0.08
210	688618	三旺通信	400	12,308.00	0.08
211	688776	国光电气	200	12,268.00	0.08
212	000803	山高环能	1,800	12,204.00	0.08
213	601577	长沙银行	1,400	12,194.00	0.08
214	600011	华能国际	1,600	12,144.00	0.08
215	000792	盐湖股份	400	12,076.00	0.08
216	603279	景津装备	1,000	12,000.00	0.08
217	000755	山西高速	2,800	11,872.00	0.08
218	002271	东方雨虹	1,000	11,870.00	0.08
219	002328	新朋股份	1,600	11,744.00	0.08
220	000598	兴蓉环境	1,800	11,556.00	0.08
221	688516	奥特维	200	11,478.00	0.08
222	600761	安徽合力	700	11,452.00	0.08
223	600866	星湖科技	2,600	11,414.00	0.08
224	600871	石化油服	5,600	11,368.00	0.08
225	002545	东方铁塔	700	11,354.00	0.08
226	002174	游族网络	900	11,349.00	0.08
227	002320	海峡股份	1,800	11,286.00	0.08
228	300709	精研科技	200	11,250.00	0.08
229	002886	沃特股份	400	11,236.00	0.08
230	002928	华夏航空	1,600	11,184.00	0.07
231	300767	震安科技	500	11,145.00	0.07
232	300497	富祥股份	500	11,080.00	0.07
233	688786	悦安新材	240	11,059.20	0.07
234	600103	青山纸业	3,600	11,052.00	0.07
235	688218	江苏北人	200	10,992.00	0.07
236	002479	富春环保	2,600	10,946.00	0.07
237	688071	华依科技	300	10,932.00	0.07
238	603823	百合花	200	10,914.00	0.07
239	688196	卓越新能	300	10,770.00	0.07
240	301198	喜悦智行	800	10,720.00	0.07

241	300304	云意电气	600	10,710.00	0.07
242	688580	伟思医疗	200	10,654.00	0.07
243	605117	德业股份	100	10,618.00	0.07
244	002481	双塔食品	2,800	10,612.00	0.07
245	002484	江海股份	100	10,500.00	0.07
246	300596	利安隆	200	10,496.00	0.07
247	603511	爱慕股份	900	10,350.00	0.07
248	600933	爱柯迪	700	10,346.00	0.07
249	300986	志特新材	600	10,290.00	0.07
250	603727	博迈科	600	10,236.00	0.07
251	600259	中稀有色	100	10,161.00	0.07
252	605168	三人行	200	10,128.00	0.07
253	688208	道通科技	400	10,076.00	0.07
254	688598	金博股份	200	9,890.00	0.07
255	000415	渤海租赁	2,400	9,768.00	0.07
256	688355	明志科技	500	9,625.00	0.06
257	605599	菜百股份	700	9,590.00	0.06
258	600395	盘江股份	2,100	9,576.00	0.06
258	600596	新安股份	600	9,576.00	0.06
259	688231	隆达股份	260	9,549.80	0.06
260	600888	新疆众和	600	9,534.00	0.06
261	605222	起帆电缆	400	9,328.00	0.06
262	600483	福能股份	900	9,171.00	0.06
263	000786	北新建材	500	9,045.00	0.06
264	600595	中孚实业	1,600	8,992.00	0.06
265	000852	石化机械	1,800	8,928.00	0.06
266	603198	迎驾贡酒	300	8,880.00	0.06
267	601579	会稽山	600	8,814.00	0.06
268	601333	广深铁路	3,200	8,800.00	0.06
269	300894	火星人	700	8,792.00	0.06
270	601872	招商轮船	500	8,785.00	0.06
271	002057	中钢天源	700	8,701.00	0.06
272	601233	桐昆股份	400	8,660.00	0.06
273	601665	齐鲁银行	1,500	8,655.00	0.06
274	600941	中国移动	100	8,613.00	0.06
275	000758	中色股份	1,300	8,541.00	0.06
276	600549	厦门钨业	100	8,520.00	0.06
277	300662	科锐国际	500	8,490.00	0.06
278	000928	中钢国际	1,700	8,466.00	0.06
279	002163	海南发展	1,000	8,340.00	0.06
280	000800	一汽解放	1,400	8,330.00	0.06
281	603689	皖天然气	1,200	8,316.00	0.06
282	002558	巨人网络	300	8,268.00	0.06

283	000059	华锦股份	2,200	8,250.00	0.06
284	600782	新钢股份	3,300	8,184.00	0.05
285	000550	江铃汽车	500	8,110.00	0.05
286	600033	福建高速	2,500	8,050.00	0.05
287	300432	富临精工	400	8,036.00	0.05
288	603345	安井食品	100	8,019.00	0.05
289	600335	国机汽车	1,700	7,956.00	0.05
290	600787	中储股份	1,900	7,942.00	0.05
291	600900	长江电力	300	7,941.00	0.05
292	600535	天士力	600	7,938.00	0.05
293	002458	益生股份	1,010	7,847.70	0.05
294	000685	中山公用	700	7,812.00	0.05
295	301371	敷尔佳	300	7,800.00	0.05
296	600717	天津港	2,000	7,780.00	0.05
297	600773	西藏城投	600	7,722.00	0.05
298	300863	卡倍亿	100	7,663.00	0.05
299	002911	佛燃能源	800	7,592.00	0.05
300	600027	华电国际	1,700	7,565.00	0.05
301	000333	美的集团	100	7,553.00	0.05
302	000528	柳 工	1,000	7,550.00	0.05
303	601877	正泰电器	300	7,521.00	0.05
304	600479	千金药业	800	7,440.00	0.05
305	002158	汉钟精机	200	7,416.00	0.05
306	000612	焦作万方	700	7,413.00	0.05
307	600176	中国巨石	100	7,288.00	0.05
308	002757	南兴股份	400	7,220.00	0.05
309	603713	密尔克卫	100	7,117.00	0.05
310	600415	小商品城	700	7,112.00	0.05
311	000932	华菱钢铁	2,000	6,940.00	0.05
312	002841	视源股份	200	6,906.00	0.05
313	603987	康德莱	1,000	6,900.00	0.05
314	603726	朗迪集团	200	6,850.00	0.05
315	000581	威孚高科	400	6,808.00	0.05
316	605319	无锡振华	300	6,807.00	0.05
317	000975	山金国际	400	6,800.00	0.05
318	000709	河钢股份	3,500	6,790.00	0.05
319	300773	拉卡拉	440	6,732.00	0.04
320	603096	新经典	500	6,690.00	0.04
321	603185	弘元绿能	400	6,676.00	0.04
322	000739	普洛药业	400	6,664.00	0.04
323	002167	东方锆业	300	6,621.00	0.04
324	300908	仲景食品	300	6,612.00	0.04
325	002215	诺 普 信	800	6,584.00	0.04

326	000828	东莞控股	700	6,552.00	0.04
327	600598	北大荒	600	6,504.00	0.04
327	601566	九牧王	800	6,504.00	0.04
328	605099	共创草坪	200	6,440.00	0.04
329	002120	韵达股份	1,000	6,360.00	0.04
330	601126	四方股份	100	6,320.00	0.04
331	601766	中国中车	1,200	6,240.00	0.04
332	300553	集智股份	100	6,139.00	0.04
333	603225	新凤鸣	300	5,895.00	0.04
334	688357	建龙微纳	200	5,894.00	0.04
335	001338	永顺泰	700	5,873.00	0.04
336	002833	弘亚数控	300	5,787.00	0.04
337	002478	常宝股份	900	5,562.00	0.04
338	603587	地素时尚	500	5,555.00	0.04
339	000338	潍柴动力	200	5,450.00	0.04
340	601985	中国核电	600	5,418.00	0.04
340	603323	苏农银行	1,400	5,418.00	0.04
341	301658	首航新能	200	5,394.00	0.04
342	600694	大商股份	400	5,292.00	0.04
343	601966	玲珑轮胎	500	5,095.00	0.03
344	600585	海螺水泥	300	5,085.00	0.03
345	600125	铁龙物流	1,000	5,070.00	0.03
346	000708	中信特钢	400	5,048.00	0.03
347	603078	江化微	100	4,942.00	0.03
348	600425	青松建化	1,500	4,905.00	0.03
349	603611	诺力股份	300	4,857.00	0.03
350	603799	华友钴业	100	4,826.00	0.03
351	300358	楚天科技	600	4,800.00	0.03
351	301080	百普赛斯	100	4,800.00	0.03
352	002648	卫星化学	200	4,698.00	0.03
353	000987	越秀资本	600	4,692.00	0.03
354	600428	中远海特	600	4,686.00	0.03
355	600377	宁沪高速	400	4,628.00	0.03
356	000301	东方盛虹	400	4,580.00	0.03
357	301168	通灵股份	100	4,491.00	0.03
358	600116	三峡水利	800	4,480.00	0.03
359	000048	京基智农	200	4,418.00	0.03
360	600210	紫江企业	700	4,340.00	0.03
361	002061	浙江交科	1,300	4,290.00	0.03
362	603006	联明股份	300	4,275.00	0.03
363	301039	中集车辆	600	4,230.00	0.03
364	002966	苏州银行	600	4,176.00	0.03
365	002330	得利斯	1,200	4,152.00	0.03

366	300821	东岳硅材	200	4,112.00	0.03
367	603798	康普顿	300	4,104.00	0.03
368	000088	盐田港	1,000	4,090.00	0.03
369	600219	南山铝业	1,000	3,990.00	0.03
370	300415	伊之密	200	3,982.00	0.03
371	301301	川宁生物	500	3,970.00	0.03
372	600037	歌华有线	600	3,762.00	0.03
373	300307	慈星股份	500	3,685.00	0.02
374	601898	中煤能源	300	3,654.00	0.02
375	600639	浦东金桥	400	3,648.00	0.02
376	601860	紫金银行	1,500	3,630.00	0.02
377	002010	传化智联	800	3,576.00	0.02
378	600970	中材国际	500	3,565.00	0.02
379	002852	道道全	500	3,545.00	0.02
380	603027	千禾味业	500	3,485.00	0.02
381	688105	诺唯赞	200	3,470.00	0.02
382	600885	宏发股份	100	3,449.00	0.02
383	603167	渤海轮渡	400	3,428.00	0.02
384	300737	科顺股份	500	3,285.00	0.02
385	600617	国新能源	1,200	3,216.00	0.02
386	000949	新乡化纤	500	3,170.00	0.02
387	605186	健麾信息	100	3,136.00	0.02
388	603889	新澳股份	600	3,066.00	0.02
389	600908	无锡银行	600	3,048.00	0.02
390	603808	歌力思	400	3,028.00	0.02
391	600987	航民股份	500	3,025.00	0.02
392	300928	华安鑫创	100	2,888.00	0.02
393	600073	光明肉业	600	2,796.00	0.02
394	603197	保隆科技	100	2,794.00	0.02
395	600060	海信视像	100	2,787.00	0.02
396	002345	潮宏基	300	2,751.00	0.02
397	000703	恒逸石化	200	2,714.00	0.02
398	002803	吉宏股份	100	2,584.00	0.02
399	600000	浦发银行	300	2,583.00	0.02
400	000531	穗恒运 A	400	2,396.00	0.02
401	601969	海南矿业	300	2,373.00	0.02
402	600098	广州发展	400	2,364.00	0.02
403	601968	宝钢包装	600	2,352.00	0.02
404	301216	万凯新材	100	2,299.00	0.02
405	600742	富维股份	300	2,172.00	0.01
406	002346	柘中股份	100	2,139.00	0.01
407	001696	宗申动力	100	2,081.00	0.01
408	600690	海尔智家	100	2,041.00	0.01

409	002266	浙富控股	400	2,024.00	0.01
410	002267	陕天然气	300	1,962.00	0.01
411	002396	星网锐捷	100	1,917.00	0.01
412	600704	物产中大	400	1,888.00	0.01
413	603010	万盛股份	100	1,812.00	0.01
414	002111	威海广泰	200	1,800.00	0.01
415	605577	龙版传媒	200	1,762.00	0.01
416	600688	上海石化	600	1,758.00	0.01
417	600062	华润双鹤	100	1,604.00	0.01
418	600803	新奥股份	100	1,580.00	0.01
419	600500	中化国际	200	1,566.00	0.01
420	000012	南 玻 A	300	1,548.00	0.01
421	600827	百联股份	200	1,482.00	0.01
422	600955	维远股份	100	1,472.00	0.01
423	600966	博汇纸业	300	1,434.00	0.01
424	600726	华电能源	200	1,424.00	0.01
425	300012	华测检测	100	1,386.00	0.01
426	002745	木林森	100	1,255.00	0.01
427	603121	华培动力	100	1,175.00	0.01
428	000719	中原传媒	100	1,143.00	0.01
429	603711	香飘飘	100	1,111.00	0.01
430	002668	TCL 智家	100	1,108.00	0.01
431	603408	建霖家居	100	965.00	0.01
432	600380	健康元	100	942.00	0.01
433	603708	家家悦	100	858.00	0.01
434	000886	海南高速	200	816.00	0.01
435	600718	东软集团	100	724.00	0.00
436	000900	现代投资	200	692.00	0.00
437	000027	深圳能源	100	620.00	0.00
438	000521	长虹美菱	100	543.00	0.00
439	600403	大有能源	100	529.00	0.00
440	002382	蓝帆医疗	100	508.00	0.00
441	603999	读者传媒	100	500.00	0.00
442	002391	长青股份	100	487.00	0.00
443	002004	华邦健康	100	393.00	0.00
444	600166	福田汽车	100	291.00	0.00
445	601828	美凯龙	100	204.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002215	诺 普 信	569,498.00	3.36
2	000933	神火股份	512,982.00	3.03

3	000983	山西焦煤	511,458.00	3.02
4	600188	兖矿能源	468,104.00	2.76
5	000776	广发证券	462,597.00	2.73
6	601187	厦门银行	452,047.00	2.67
7	002948	青岛银行	428,693.00	2.53
8	601168	西部矿业	415,814.00	2.45
9	601963	重庆银行	414,015.00	2.44
10	601666	平煤股份	410,840.00	2.42
11	600489	中金黄金	407,782.00	2.41
12	605599	菜百股份	389,286.00	2.30
13	601009	南京银行	382,549.00	2.26
14	600971	恒源煤电	380,521.00	2.25
15	002117	东港股份	364,435.00	2.15
16	000807	云铝股份	361,434.00	2.13
17	002043	兔宝宝	357,278.00	2.11
18	600323	瀚蓝环境	356,504.00	2.10
19	601001	晋控煤业	355,218.00	2.10
20	601699	潞安环能	343,717.00	2.03
21	300415	伊之密	341,179.00	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。

7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600188	兖矿能源	608,690.00	3.59
2	002215	诺普信	605,322.00	3.57
3	601963	重庆银行	577,818.00	3.41
4	600325	华发股份	465,336.00	2.75
5	601168	西部矿业	462,452.00	2.73
6	002117	东港股份	446,157.00	2.63
7	605599	菜百股份	398,360.00	2.35
8	000776	广发证券	393,817.00	2.32
9	002993	奥海科技	382,914.00	2.26
10	002948	青岛银行	362,521.00	2.14
11	600971	恒源煤电	358,807.00	2.12
12	000090	天健集团	345,025.00	2.04
13	002803	吉宏股份	344,601.00	2.03
14	601009	南京银行	344,210.00	2.03
15	601717	中创智领	343,164.00	2.03
16	601187	厦门银行	341,597.00	2.02
17	600057	厦门象屿	333,286.00	1.97
18	603929	亚翔集成	327,852.00	1.93
19	300415	伊之密	325,794.00	1.92
20	600323	瀚蓝环境	324,977.00	1.92

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	57,500,214.42
卖出股票收入（成交）总额	58,407,533.08

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

1、时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

2、套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

3、合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可投资国债期货，本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金可投资国债期货，本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

7.12 投资组合报告附注

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

南京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方监管局处罚。

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未出现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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,080.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,080.36

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
景顺长城红利量化选股股票 A	351	19,465.00	-	-	6,832,214.54	100.00
景顺长城红利量化选股股票 C	307	24,549.88	-	-	7,536,812.20	100.00
合计	658	21,837.43	-	-	14,369,026.74	100.00

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	54.14

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	景顺长城红利量化选股股票 A	118,747.27	1.738049
	景顺长城红利量化选股股票 C	10,010.29	0.132819
	合计	128,757.56	0.896077

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	景顺长城红利量化选股股票 A	-
	景顺长城红利量化选股股票 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城红利量化选股股票 A	10~50
	景顺长城红利量化选股股票 C	-

	合计	10~50
--	----	-------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城红利量化选股股票 A	景顺长城红利量化选股股票 C
基金合同生效日 (2025 年 1 月 24 日) 基金份额总额	41,053,104.54	172,666,684.74
本报告期期初基金份 额总额	7,428,208.60	8,108,722.85
本报告期基金总申购 份额	2,325,630.13	5,168,126.25
减：本报告期基金总 赎回份额	2,921,624.19	5,740,036.90
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	6,832,214.54	7,536,812.20

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

根据《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》和《景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司经与本基金的基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，以通讯开会方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议关于持续运作本基金的议案。根据统计结果，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额未达到权益登记日本基金总份额的 50%，因此未达到法定的会议召开条件。有关详细信息参见本基金管理人于 2026 年 4 月 28 日发布的《景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：
报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。
基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：
报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰海通证券股份有限公司	3	115,907,747.50	100.00	52,711.74	100.00	未变更

注：1、基金管理人选择交易单元的标准为：交易单元所属券商财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强。

2、基金管理人选择交易单元参与证券交易的程序为：基金管理人定期对符合上述标准的券商进行测评，测评结果是决定后期使用各证券公司交易单元参与证券交易的依据。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 20 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 22 日
3	景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 22 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 27 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 25 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 26 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 23 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金基金份额持有人大会第一次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 24 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金基金份额持有人大会第二次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 25 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 25 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 27 日
12	景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 27 日
13	景顺长城基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况 (2025 年度)	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 31 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 7 日

15	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 21 日
16	景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 22 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 22 日
18	景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 28 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 29 日
20	2025 年度景顺长城基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 29 日
21	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增挖财基金为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 8 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 12 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于部分基金投顾组合终止的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 13 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申万宏源证券和申万宏源西部证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 15 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 21 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 22 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 27 日
28	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 2 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 9 日
30	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增排排网销售为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 22 日
31	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 23 日
32	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
个人	1	20260101-20260630	3,351,736.52	-	-	3,351,736.52	23.33

产品特有风险

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

1、大额申购风险

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

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

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

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

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

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

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

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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《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》和《景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司经与本基金的基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，以通讯开会方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议关于持续运作本基金的议案。根据统计结果，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额未达到权益登记日本基金总份额的 50%，因此未达到法定的会议召开条件。有关详细信息参见本基金管理人于 2026 年 4 月 28 日发布的《景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金基金份额持有

人大会会议情况的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城红利量化选股股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城红利量化选股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。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日