

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 基金管理人及基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

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	54
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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 市场中性策略执行情况	54
7.13 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 盈利投资者数量占比	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
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	58
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合	
基金主代码	008851	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 2 月 27 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	49,835,616.07 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 A	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 C
下属分级基金的交易代码	008851	023270
报告期末下属分级基金的份额总额	40,030,623.46 份	9,804,992.61 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型和绝对收益策略，有效对冲市场系统性风险，追求长期稳定的绝对收益。
投资策略	本基金主要采用量化对冲的投资策略，一方面坚持采用基金管理人自主研发的量化模型构建股票投资组合，另一方面，灵活应用多种绝对收益策略有效对冲本基金的系统性风险，例如做空股指期货进行对冲操作，获取选股的超额收益，追求长期稳定的绝对收益。 1、股票投资策略 本基金采用灵活配置的投资策略，根据基金所使用对冲工具的年化对冲成本来决定当月股票资产的投资比例，建仓期（6 个月）内不受仓位调整机制的约束，建仓期满的第一个月起（包括第一个月），如基金所使用对冲工具的年化对冲成本达到仓位调整阈值，则触发仓位调整机制。 2、对冲策略 本基金现阶段主要通过股指期货有效对冲持有股票的系统性风险。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理和风险控制的原则，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金通过对现货和期货市场相关性研究，计算需要的股指期货合约数量，并根据不同期货合约定价关系、保证金要求、流动性情况等因素，对股指期货合约数量及配比进行动态调整，寻求与现货资产的匹配，力争构建市场中性投资组合并获得稳定的正向超额收益。 3、套利策略 本基金寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉套利和绝对收益机会，以提高资本的利用率，从而达到投资策略的多元化，努力进一

	步提高绝对收益水平，例如股指期货套利、统计套利、定向增发套利、大宗交易套利、并购套利等。
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期 1 年定期存款基准利率（税后）+1%。
风险收益特征	本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	郭明
	联系电话	0755-82370388	(010) 66105799
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755-22381339	(010) 66105798
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		叶才	廖林

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)	
	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 A	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 C
本期已实现收益	-156,638.71	-63,960.69
本期利润	758,319.91	144,642.68

加权平均基金份额本期利润	0.0182	0.0148
本期加权平均净值利润率	1.76%	1.43%
本期基金份额净值增长率	1.75%	1.44%
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	655,300.83	188,303.00
期末可供分配基金份额利润	0.0164	0.0192
期末基金资产净值	41,506,635.56	10,170,562.94
期末基金份额净值	1.0368	1.0372
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	3.68%	0.56%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	0.50%	0.23%	0.62%	0.01%	-0.12%	0.22%
过去六个月	1.75%	0.20%	1.24%	0.01%	0.51%	0.19%
过去一年	1.11%	0.18%	2.50%	0.01%	-1.39%	0.17%
过去三年	0.73%	0.24%	7.50%	0.01%	-6.77%	0.23%
过去五年	-3.02%	0.27%	12.50%	0.01%	-15.52%	0.26%
自基金合同生效起至今	3.68%	0.28%	15.85%	0.01%	-12.17%	0.27%

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.35%	0.23%	0.62%	0.01%	-0.27%	0.22%
过去六个月	1.44%	0.20%	1.24%	0.01%	0.20%	0.19%
过去一年	1.26%	0.18%	2.50%	0.01%	-1.24%	0.17%
自基金合同生效起至今	0.56%	0.18%	3.42%	0.01%	-2.86%	0.17%

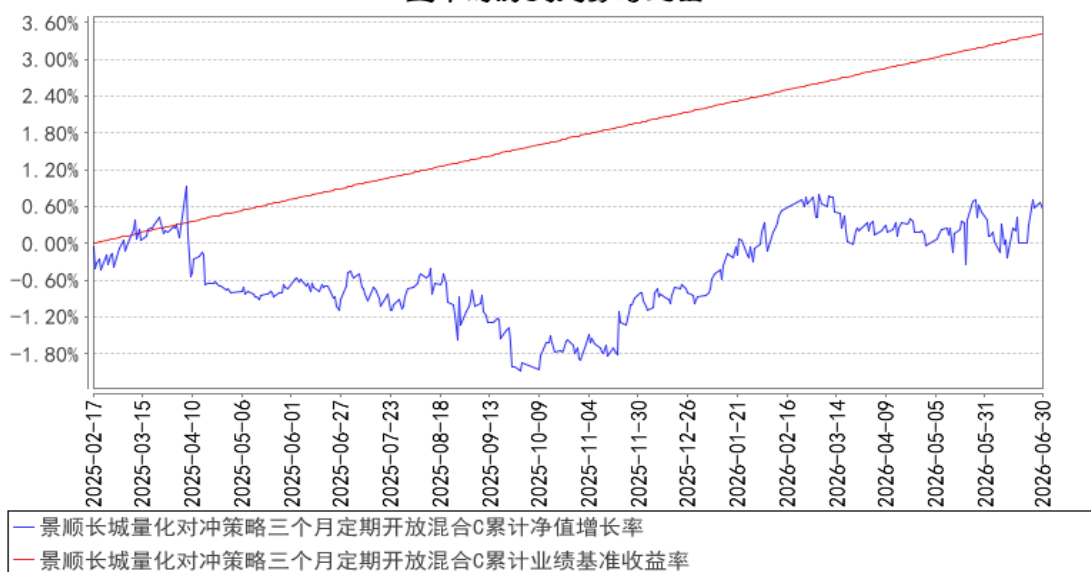
注：本基金于 2025 年 02 月 12 日增设 C 类基金份额，并于 2025 年 02 月 17 日开始对 C 类份额进行估值。

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

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：本基金权益类多头头寸的价值减去本基金权益类空头头寸的价值占基金资产净值的 0-10%之间。本基金投资于同业存单和银行存款的合计占比不超过基金资产的 20%。在开放期的每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。在开放期，每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货

合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。本基金的建仓期为自 2020 年 2 月 27 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。本基金自 2025 年 2 月 12 日起增设 C 类基金份额。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 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	2020 年 2 月 27 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。
--	--	--	--	--	--------

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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、《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式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 1.75%，业绩比较基准收益率为 1.24%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 1.44%，业绩比较基准收益率为 1.24%。

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。股指期货方面，随着市场情绪改善，在基差快速收敛之后，产品的对冲成本有望得到改善，我们将继续择机提升对冲仓位水平。

本基金主要采用量化对冲的投资策略，一方面坚持采用基金管理人自主研发的量化模型构建股票投资组合，另一方面，灵活应用多种绝对收益策略有效对冲本基金的系统性风险，获取选股的超额收益，追求长期稳定的绝对收益。

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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	11,799,440.11	5,397,097.66
结算备付金		7,464,975.24	10,506,697.50
存出保证金		3,332,187.13	4,011,812.50
交易性金融资产	6.4.7.2	28,967,978.65	34,874,925.20
其中：股票投资		28,967,978.65	34,874,925.20
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		570,287.84	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		52,134,868.97	54,790,532.86
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		333,041.41	71,280.53
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		50,767.69	55,567.93
应付托管费		8,461.25	9,261.33
应付销售服务费		4,996.81	5,109.51
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	60,403.31	119,760.99
负债合计		457,670.47	260,980.29
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	49,835,616.07	53,475,093.88
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,841,582.43	1,054,458.69
净资产合计		51,677,198.50	54,529,552.57
负债和净资产总计		52,134,868.97	54,790,532.86

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 49,835,616.07 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.0368 元，基金份额 40,030,623.46 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.0372 元，基金份额 9,804,992.61 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
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 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,351,828.31	123,350.90
1. 利息收入		74,092.64	71,079.47
其中：存款利息收入	6.4.7.13	74,092.64	71,079.47
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）		153,976.06	2,157,094.15
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,011,198.14	223,975.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,816.23	1,460.82
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-2,117,016.67	1,484,781.04
股利收益	6.4.7.19	257,978.36	446,877.08
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	1,123,561.99	-2,104,845.75
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	197.62	23.03
减：二、营业总支出		448,865.72	469,046.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	316,324.18	347,414.81
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	52,720.70	57,902.50
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	30,141.54	6,136.72
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		-	7,903.40
8. 其他费用	6.4.7.23	49,679.30	49,688.74
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		902,962.59	-345,695.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		902,962.59	-345,695.27
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		902,962.59	-345,695.27

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	53,475,093.88	-	1,054,458.69	54,529,552.57

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	53,475,093.88	-	1,054,458.69	54,529,552.57
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,639,477.81	-	787,123.74	-2,852,354.07
(一)、综合收益总额	-	-	902,962.59	902,962.59
(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)	-3,639,477.81	-	-115,838.85	-3,755,316.66
其中：1. 基金申购款	253,672.07	-	8,023.20	261,695.27
2. 基金赎回款	-3,893,149.88	-	-123,862.05	-4,017,011.93
(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	49,835,616.07	-	1,841,582.43	51,677,198.50
项目	上年度可比期间			
	2025 年 1 月 1 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	58,116,722.93	-	1,852,448.38	59,969,171.31
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	58,116,722.93	-	1,852,448.38	59,969,171.31

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,572,643.87	-	-342,718.54	1,229,925.33
(一)、综合收益总额	-	-	-345,695.27	-345,695.27
(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)	1,572,643.87	-	2,976.73	1,575,620.60
其中：1. 基金申购款	9,502,007.72	-	226,329.92	9,728,337.64
2. 基金赎回款	-7,929,363.85	-	-223,353.19	-8,152,717.04
(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	59,689,366.80	-	1,509,729.84	61,199,096.64

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

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（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[2019]2891 号《关于准予景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式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《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式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 2,803,173,163.28 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（2020）第 0106 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 2 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,803,947,219.94 份基金份额，其中认购资金利息折合 774,056.66 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购方认购本基金的总额不少于人民币 1,000 万元，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许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、政府支持机构债、政府支持债券、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）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债）、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资融券业务交易。本基金的投资组合比例为：本基金权益类多头头寸的价值减去本基金权益类空头头寸的价值占基金资产净值的 0-10% 之间。其中：权益类多头头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。权益类空头头寸价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值。本基金投资于同业存单和银行存款的合计占比不超过基金资产的 20%。开放期内每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。开放期每个交易日日终，在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。在封闭期内，本基金不受前述 5% 的限制。

本基金以定期开放的方式运作。本基金每三个月开放一次，每次开放期不超过 5 个工作日，

每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份在后续每三个日历月中最后一个日历月，每个开放期的首日为当月沪深 300 股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购、赎回与转换业务，且不上市交易。

本基金自 2025 年 2 月 12 日起增设 C 类基金份额，原份额转为 A 类基金份额。

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 第 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	11,799,440.11
等于：本金	11,798,410.68
加：应计利息	1,029.43
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	11,799,440.11

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	27,497,711.68	-	28,967,978.65	1,470,266.97
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	27,497,711.68	-	28,967,978.65	1,470,266.97

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 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	-27,593,040.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-27,593,040.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-27,593,040.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的国债/股指期货投资期末合同/名义金额为初始合约价值。

6.4.7.3.2 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
IF2609	IF2609	-19.00	-27,643,860.00	-50,820.00
合计				-50,820.00
减：可抵销期货暂收款				-50,820.00
净额				0.00

注：1、衍生金融资产项下的国债/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国债/股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债/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。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	10,814.74
其中：交易所市场	10,814.74
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	49,588.57
合计	60,403.31

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 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	43,670,101.27	43,670,101.27
本期申购	253,575.29	253,575.29
本期赎回（以“-”号填列）	-3,893,053.10	-3,893,053.10
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	40,030,623.46	40,030,623.46

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 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	9,804,992.61	9,804,992.61
本期申购	96.78	96.78
本期赎回（以“-”号填列）	-96.78	-96.78
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	9,804,992.61	9,804,992.61

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	865,314.36	-31,783.36	833,531.00
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	865,314.36	-31,783.36	833,531.00
本期利润	-156,638.71	914,958.62	758,319.91
本期基金份额交易产生的变动数	-53,374.82	-62,463.99	-115,838.81
其中：基金申购款	6,237.37	1,782.61	8,019.98
基金赎回款	-59,612.19	-64,246.60	-123,858.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	655,300.83	820,711.27	1,476,012.10

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	252,266.34	-31,338.65	220,927.69
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	252,266.34	-31,338.65	220,927.69
本期利润	-63,960.69	208,603.37	144,642.68
本期基金份额交易产生的变动数	-2.65	2.61	-0.04
其中：基金申购款	0.80	2.42	3.22
基金赎回款	-3.45	0.19	-3.26
本期已分配利润	-	-	-

本期末	188,303.00	177,267.33	365,570.33
-----	------------	------------	------------

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	21,116.75
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	52,933.44
其他	42.45
合计	74,092.64

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	2,011,198.14
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	2,011,198.14

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	130,644,333.32
减：卖出股票成本总额	128,527,356.72
减：交易费用	105,778.46
买卖股票差价收入	2,011,198.14

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,815.86

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	1,816.23

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,116.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,300.00
减：应计利息总额	0.37
减：交易费用	0.17
买卖债券差价收入	1,815.86

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	-2,117,016.67

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	257,978.36
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	257,978.36

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	611,161.99
股票投资	611,161.99
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	512,400.00
权证投资	—
期货投资	512,400.00
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	1,123,561.99

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	197.62
合计	197.62

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	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	—
银行划款手续费	90.00
存托服务费	0.73
合计	49,679.30

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	316,324.18	347,414.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	104,188.13	129,297.72
应支付基金管理人的净管理费	212,136.05	218,117.09

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：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	52,720.70	57,902.50

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 A	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	-	-
中国工商银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	-	-
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 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 A	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	-	-
中国工商银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	-	-

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

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

(2) 自 2025 年 2 月 12 日起, 本基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额, 原有基金份额转为 A 类基金份额。

(3) 本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位: 份

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 A	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 C
基金合同生效日 (2020 年 2 月 27 日) 持有的基金份额	10,001,000.10	—
报告期初持有的基金份额	10,001,000.10	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减: 报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	10,001,000.10	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	24.98%	—
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 2 月 17 日 (C 类份额首个估

	值日) 至 2025 年 6 月 30 日	
	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 A	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 C
基金合同生效日 (2020 年 2 月 27 日) 持有的基金份额	10,001,000.10	—
报告期初持有的基金份额	10,001,000.10	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减: 报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	10,001,000.10	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.32%	—

注: 1、期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额, 期间赎回/卖出总份额含转换出份额;

2、对于分级基金, 报告期末持有的基金份额占比计算时分母采用各自级别的份额;

3、投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

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 1 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
中国工商银行 - 活期	11,799,440.11	21,116.75	5,041,722.18	18,900.12

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同责任，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	11,799,440.1	-	-	-	-	-	11,799,440.1

	1						1
结算备付金	7,464,975.24	-	-	-	-	-	7,464,975.24
存出保证金	14,923.93	-	-	-	-	3,317,263.20	3,332,187.13
交易性金融资产	-	-	-	-	-	28,967,978.65	28,967,978.65
应收清算款	-	-	-	-	-	570,287.84	570,287.84
资产总计	19,279,339.28	-	-	-	-	32,855,529.69	52,134,868.97
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	50,767.69	50,767.69
应付托管费	-	-	-	-	-	8,461.25	8,461.25
应付清算款	-	-	-	-	-	333,041.41	333,041.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,996.81	4,996.81
其他负债	-	-	-	-	-	60,403.31	60,403.31
负债总计	-	-	-	-	-	457,670.47	457,670.47
利率敏感度缺口	19,279,339.28	-	-	-	-	-	-
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	5,397,097.66	-	-	-	-	-	5,397,097.66
结算备付金	10,506,697.50	-	-	-	-	-	10,506,697.50
存出保证金	21,514.90	-	-	-	-	3,990,297.60	4,011,812.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	34,874,925.20	34,874,925.20
资产总计	15,925,310.06	-	-	-	-	38,865,222.80	54,790,532.86
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	55,567.93	55,567.93
应付托管费	-	-	-	-	-	9,261.33	9,261.33
应付清算款	-	-	-	-	-	71,280.53	71,280.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,109.51	5,109.51
其他负债	-	-	-	-	-	119,760.99	119,760.99
负债总计	-	-	-	-	-	260,980.29	260,980.29
利率敏感度缺口	15,925,310.06	-	-	-	-	-	-

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	28,967,978.65	56.06	34,874,925.20	63.96
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	28,967,978.65	56.06	34,874,925.20	63.96

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注：6.4.7.3）。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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月

			31 日)
	沪深 300 指数上升 5%	146, 121. 30	22, 575. 56
	沪深 300 指数下降 5%	-146, 121. 30	-22, 575. 56

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	28, 967, 978. 65	34, 674, 730. 20
第二层次	-	200, 195. 00
第三层次	-	-
合计	28, 967, 978. 65	34, 874, 925. 20

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	28,967,978.65	55.56
	其中：股票	28,967,978.65	55.56
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	19,264,415.35	36.95
8	其他各项资产	3,902,474.97	7.49
9	合计	52,134,868.97	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	180,122.00	0.35
B	采矿业	1,452,005.00	2.81
C	制造业	17,342,717.25	33.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,034,505.00	2.00
E	建筑业	174,308.00	0.34
F	批发和零售业	206,758.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	1,058,150.00	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,860,576.00	3.60
J	金融业	4,482,199.00	8.67
K	房地产业	219,723.00	0.43

L	租赁和商务服务业	264,635.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	459,309.40	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	39,246.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	17,175.00	0.03
Q	卫生和社会工作	37,170.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	139,380.00	0.27
S	综合	-	-
	合计	28,967,978.65	56.06

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	300308	中际旭创	1,200	1,524,000.00	2.95
2	300750	宁德时代	2,400	943,224.00	1.83
3	300502	新易盛	1,428	866,796.00	1.68
4	688256	寒武纪	400	638,220.00	1.24
5	603986	兆易创新	700	570,500.00	1.10
6	600519	贵州茅台	400	474,196.00	0.92
7	600900	长江电力	14,200	375,874.00	0.73
8	688521	芯原股份	1,000	371,140.00	0.72
9	002384	东山精密	1,400	367,290.00	0.71
10	688041	海光信息	908	336,232.40	0.65
11	603259	药明康德	2,700	336,177.00	0.65
12	688012	中微公司	694	325,139.00	0.63
13	601318	中国平安	6,700	319,858.00	0.62
14	300408	三环集团	1,800	300,420.00	0.58
15	688008	澜起科技	967	299,673.30	0.58
16	600183	生益科技	1,600	277,440.00	0.54
17	600176	中国巨石	3,800	276,944.00	0.54
18	601899	紫金矿业	10,700	268,998.00	0.52
19	002371	北方华创	300	265,368.00	0.51
20	600919	江苏银行	23,600	254,408.00	0.49
21	000725	京东方 A	28,400	246,512.00	0.48
22	601009	南京银行	24,500	242,305.00	0.47
23	002916	深南电路	500	228,950.00	0.44
24	601229	上海银行	26,200	227,416.00	0.44
25	601988	中国银行	39,500	225,940.00	0.44
26	002475	立讯精密	3,200	225,280.00	0.44
27	601688	华泰证券	10,900	224,758.00	0.43

28	601872	招商轮船	12,600	221,382.00	0.43
29	601211	国泰海通	12,100	220,220.00	0.43
30	600460	士兰微	3,900	213,174.00	0.41
31	600036	招商银行	5,800	205,900.00	0.40
32	600115	中国东航	54,000	205,740.00	0.40
33	600489	中金黄金	11,000	198,550.00	0.38
34	002558	巨人网络	7,200	198,432.00	0.38
35	002353	杰瑞股份	1,300	198,250.00	0.38
36	600030	中信证券	6,700	192,491.00	0.37
37	601138	工业富联	2,600	187,590.00	0.36
38	600886	国投电力	14,000	186,340.00	0.36
39	601328	交通银行	28,600	183,898.00	0.36
40	002415	海康威视	5,300	181,260.00	0.35
41	300476	胜宏科技	500	173,215.00	0.34
42	000975	山金国际	10,000	170,000.00	0.33
43	002463	沪电股份	1,100	168,080.00	0.33
44	000776	广发证券	7,000	163,800.00	0.32
45	600028	中国石化	36,500	162,790.00	0.32
46	300274	阳光电源	1,000	159,020.00	0.31
47	601058	赛轮轮胎	13,400	154,502.00	0.30
48	300394	天孚通信	500	151,340.00	0.29
49	002532	天山铝业	13,800	148,074.00	0.29
50	000425	徐工机械	18,200	147,238.00	0.28
51	600549	厦门钨业	1,700	144,840.00	0.28
52	300661	圣邦股份	1,000	143,480.00	0.28
53	600522	中天科技	2,300	139,564.00	0.27
54	600547	山东黄金	5,900	136,231.00	0.26
55	600015	华夏银行	21,000	134,190.00	0.26
56	601336	新华保险	2,200	131,252.00	0.25
57	300014	亿纬锂能	2,000	130,060.00	0.25
58	000333	美的集团	1,700	128,401.00	0.25
59	000166	申万宏源	28,600	125,840.00	0.24
60	603799	华友钴业	2,600	125,476.00	0.24
61	600584	长电科技	1,200	124,260.00	0.24
62	601898	中煤能源	10,000	121,800.00	0.24
63	601319	中国人保	17,600	118,976.00	0.23
64	601100	恒立液压	1,100	118,316.00	0.23
65	601985	中国核电	13,100	118,293.00	0.23
66	601288	农业银行	18,600	112,902.00	0.22
67	002837	英维克	1,400	111,384.00	0.22
68	000988	华工科技	600	110,766.00	0.21
69	688981	中芯国际	692	109,903.44	0.21
70	601377	兴业证券	17,800	107,512.00	0.21

71	002311	海大集团	2,400	107,064.00	0.21
72	600025	华能水电	11,900	105,791.00	0.20
73	600029	南方航空	20,400	105,672.00	0.20
74	002714	牧原股份	3,000	104,970.00	0.20
75	600150	中国船舶	3,095	104,580.05	0.20
76	601117	中国化学	14,000	102,900.00	0.20
77	002027	分众传媒	21,200	102,608.00	0.20
78	600999	招商证券	4,800	101,280.00	0.20
79	601111	中国国航	16,600	100,430.00	0.19
80	600809	山西汾酒	900	98,433.00	0.19
81	000338	潍柴动力	3,600	98,100.00	0.19
82	601127	赛力斯	1,600	98,000.00	0.19
83	300413	芒果超媒	6,600	96,558.00	0.19
84	000858	五 粮 液	1,300	96,200.00	0.19
85	601919	中远海控	7,100	94,146.00	0.18
86	603096	新经典	6,900	92,322.00	0.18
87	002661	克明食品	13,200	91,476.00	0.18
88	603993	洛阳钼业	5,200	91,260.00	0.18
89	000792	盐湖股份	3,000	90,570.00	0.18
90	300193	佳士科技	11,100	90,354.00	0.17
91	000938	紫光股份	3,100	89,466.00	0.17
92	601998	中信银行	12,900	89,397.00	0.17
93	603648	畅联股份	10,200	87,516.00	0.17
94	000657	中钨高新	900	86,148.00	0.17
95	600160	巨化股份	1,600	84,816.00	0.16
96	000001	平安银行	8,400	84,420.00	0.16
97	002142	宁波银行	2,800	83,132.00	0.16
98	605117	德业股份	780	82,820.40	0.16
99	300803	指南针	900	82,503.00	0.16
100	000959	首钢股份	23,200	81,432.00	0.16
101	002466	天齐锂业	1,300	79,716.00	0.15
102	300418	昆仑万维	1,900	76,684.00	0.15
103	600011	华能国际	10,100	76,659.00	0.15
104	300498	温氏股份	6,100	75,152.00	0.15
105	300223	北京君正	300	74,670.00	0.14
106	600019	宝钢股份	13,600	73,848.00	0.14
107	002938	鹏鼎控股	700	73,766.00	0.14
108	600276	恒瑞医药	1,400	72,856.00	0.14
109	601766	中国中车	14,000	72,800.00	0.14
110	603006	联明股份	5,000	71,250.00	0.14
111	301308	江波龙	100	70,380.00	0.14
112	000977	浪潮信息	1,000	70,000.00	0.14
113	601519	大智慧	8,000	69,040.00	0.13

114	601166	兴业银行	4,100	67,896.00	0.13
115	002493	荣盛石化	6,300	67,725.00	0.13
116	002602	世纪华通	4,800	67,680.00	0.13
117	600690	海尔智家	3,300	67,353.00	0.13
118	002851	麦格米特	400	66,872.00	0.13
119	601225	陕西煤业	3,200	65,120.00	0.13
120	600219	南山铝业	15,600	62,244.00	0.12
121	600309	万华化学	900	61,569.00	0.12
122	000869	张裕A	3,900	60,762.00	0.12
123	300759	康龙化成	2,100	60,753.00	0.12
124	603123	翠微股份	7,500	59,325.00	0.11
125	601077	渝农商行	9,700	59,267.00	0.11
126	000963	华东医药	2,100	59,052.00	0.11
127	600885	宏发股份	1,700	58,633.00	0.11
128	688396	华润微	600	58,530.00	0.11
129	002646	天佑德酒	9,200	58,052.00	0.11
130	601018	宁波港	18,400	57,960.00	0.11
131	688052	纳芯微	200	57,662.00	0.11
132	000807	云铝股份	2,600	57,564.00	0.11
133	002236	大华股份	3,400	56,066.00	0.11
134	300613	富瀚微	700	56,056.00	0.11
135	600660	福耀玻璃	1,100	55,484.00	0.11
136	600425	青松建化	16,800	54,936.00	0.11
137	002080	中材科技	600	54,000.00	0.10
138	000922	佳电股份	3,700	51,652.00	0.10
139	600515	海南机场	18,500	50,690.00	0.10
140	601555	东吴证券	6,400	50,688.00	0.10
141	600031	三一重工	2,900	50,112.00	0.10
142	300122	智飞生物	4,200	49,098.00	0.10
143	300059	东方财富	2,400	48,912.00	0.09
144	000983	山西焦煤	8,400	48,720.00	0.09
145	601825	沪农商行	6,500	48,685.00	0.09
146	688147	微导纳米	300	48,564.00	0.09
147	600026	中远海能	2,700	48,438.00	0.09
148	601881	中国银河	3,800	47,766.00	0.09
149	002662	峰璟股份	12,700	46,990.00	0.09
150	600018	上港集团	9,900	46,728.00	0.09
151	300124	汇川技术	700	46,431.00	0.09
152	002379	宏桥控股	3,100	45,787.00	0.09
153	300782	卓胜微	400	43,832.00	0.08
154	600039	四川路桥	5,600	43,792.00	0.08
155	600795	国电电力	9,300	43,431.00	0.08
156	600059	古越龙山	5,900	43,188.00	0.08

157	600426	华鲁恒升	1,800	43,056.00	0.08
158	601187	厦门银行	6,300	43,029.00	0.08
159	688111	金山办公	200	42,610.00	0.08
160	600361	创新新材	11,700	42,120.00	0.08
161	000630	铜陵有色	6,600	41,976.00	0.08
162	002852	道道全	5,900	41,831.00	0.08
163	688388	嘉元科技	940	41,360.00	0.08
164	600048	保利发展	8,900	41,207.00	0.08
165	002709	天赐材料	800	41,144.00	0.08
166	002517	恺英网络	2,500	40,625.00	0.08
167	002077	大港股份	2,100	40,509.00	0.08
168	002805	丰元股份	1,400	40,026.00	0.08
169	688059	华锐精密	200	39,942.00	0.08
170	601601	中国太保	1,400	39,928.00	0.08
171	002653	海思科	600	39,804.00	0.08
172	600681	百川能源	12,300	39,729.00	0.08
173	300993	玉马科技	3,900	37,908.00	0.07
174	001965	招商公路	4,100	37,556.00	0.07
175	601788	光大证券	2,600	37,518.00	0.07
176	301061	匠心家居	1,060	37,174.20	0.07
177	300015	爱尔眼科	4,500	37,170.00	0.07
178	300037	新宙邦	400	37,140.00	0.07
179	601999	出版传媒	6,600	36,432.00	0.07
180	000566	海南海药	7,200	35,928.00	0.07
181	600523	贵航股份	3,400	35,870.00	0.07
182	002320	海峡股份	5,700	35,739.00	0.07
183	600871	石化油服	17,500	35,525.00	0.07
184	002174	游族网络	2,800	35,308.00	0.07
185	600138	中青旅	5,400	35,262.00	0.07
186	000631	顺发恒能	11,700	34,983.00	0.07
187	000617	中油资本	5,300	34,927.00	0.07
188	000408	藏格矿业	500	34,660.00	0.07
189	002028	思源电气	200	34,600.00	0.07
190	601666	平煤股份	4,800	34,320.00	0.07
191	300363	博腾股份	2,100	34,104.00	0.07
192	300857	协创数据	100	33,990.00	0.07
193	601633	长城汽车	2,200	33,198.00	0.06
194	300307	慈星股份	4,500	33,165.00	0.06
195	002736	国信证券	3,300	32,967.00	0.06
196	600482	中国动力	1,000	32,800.00	0.06
197	688578	艾力斯	300	32,760.00	0.06
198	000034	神州数码	1,180	32,745.00	0.06
199	603296	华勤技术	440	32,678.80	0.06

200	600741	华域汽车	2,100	32,592.00	0.06
201	300450	先导智能	800	32,576.00	0.06
202	002064	华峰化学	3,400	32,266.00	0.06
203	601658	邮储银行	6,500	32,045.00	0.06
204	600641	先导基电	800	31,888.00	0.06
205	601628	中国人寿	900	31,815.00	0.06
206	601006	大秦铁路	6,900	31,809.00	0.06
207	300567	精测电子	100	31,760.00	0.06
208	600282	南钢股份	6,800	31,212.00	0.06
209	600316	洪都航空	1,100	30,734.00	0.06
210	688141	杰华特	200	30,700.00	0.06
211	603379	三美股份	400	30,356.00	0.06
212	300475	香农芯创	100	30,000.00	0.06
213	600909	华安证券	2,700	29,997.00	0.06
214	688557	兰剑智能	900	27,927.00	0.05
215	002600	领益智造	1,600	27,744.00	0.05
216	000301	东方盛虹	2,400	27,480.00	0.05
217	600926	杭州银行	1,900	27,455.00	0.05
218	601567	三星电气	1,800	26,892.00	0.05
219	600233	圆通速递	1,700	26,775.00	0.05
220	688503	聚和材料	200	26,540.00	0.05
221	688183	生益电子	200	26,480.00	0.05
222	002460	赣锋锂业	400	26,160.00	0.05
223	300432	富临精工	1,300	26,117.00	0.05
224	688331	荣昌生物	200	26,052.00	0.05
225	002266	浙富控股	5,100	25,806.00	0.05
226	603083	剑桥科技	100	25,487.00	0.05
227	300055	万邦达	3,900	25,077.00	0.05
228	688220	翱捷科技	200	24,864.00	0.05
229	300772	运达股份	2,000	24,600.00	0.05
230	300397	天和防务	1,600	24,224.00	0.05
231	300033	同花顺	100	24,100.00	0.05
232	000932	华菱钢铁	6,900	23,943.00	0.05
233	300979	华利集团	800	23,800.00	0.05
234	688223	晶科能源	5,000	23,750.00	0.05
235	605196	华通线缆	900	23,490.00	0.05
236	300732	设研院	4,000	22,280.00	0.04
237	002758	浙农股份	2,800	22,120.00	0.04
238	600808	马钢股份	8,800	22,000.00	0.04
239	688218	江苏北人	400	21,984.00	0.04
240	300919	中伟新材	500	21,875.00	0.04
241	300213	佳讯飞鸿	3,600	21,816.00	0.04
242	300765	石药创新	800	21,784.00	0.04

243	002016	世荣兆业	5,400	21,600.00	0.04
244	300776	帝尔激光	100	21,496.00	0.04
245	300433	蓝思科技	400	21,464.00	0.04
246	603019	中科曙光	200	21,446.00	0.04
247	600346	恒力石化	1,200	21,252.00	0.04
248	000589	贵州轮胎	5,100	20,706.00	0.04
249	000823	超声电子	800	20,520.00	0.04
250	688257	新锐股份	200	20,380.00	0.04
251	600095	湘财股份	2,700	20,331.00	0.04
252	688207	格灵深瞳	1,000	20,100.00	0.04
253	003816	中国广核	5,100	19,941.00	0.04
254	600113	浙江东日	600	19,908.00	0.04
255	603225	新凤鸣	1,000	19,650.00	0.04
256	600509	天富能源	2,300	19,435.00	0.04
257	002422	科伦药业	500	19,260.00	0.04
258	600570	恒生电子	900	19,071.00	0.04
259	300045	华力创通	1,100	18,964.00	0.04
260	601126	四方股份	300	18,960.00	0.04
261	600000	浦发银行	2,200	18,942.00	0.04
262	300953	震裕科技	140	18,718.00	0.04
263	301071	力量钻石	200	18,500.00	0.04
264	600988	赤峰黄金	700	18,424.00	0.04
265	300848	美瑞新材	1,300	18,135.00	0.04
266	300842	帝科股份	200	17,834.00	0.03
267	603175	超颖电子	200	17,818.00	0.03
268	002948	青岛银行	3,500	17,780.00	0.03
269	002049	紫光国微	200	17,750.00	0.03
270	300909	汇创达	300	17,466.00	0.03
271	000157	中联重科	2,500	17,425.00	0.03
272	688348	昱能科技	500	17,390.00	0.03
273	300492	华图山鼎	500	17,175.00	0.03
274	300766	每日互动	800	17,120.00	0.03
275	688676	金盘科技	200	16,928.00	0.03
276	603950	长源东谷	200	16,886.00	0.03
277	300201	海伦哲	800	16,856.00	0.03
278	688559	海目星	200	16,784.00	0.03
279	300442	润泽科技	200	16,614.00	0.03
280	300438	鹏辉能源	200	16,570.00	0.03
281	688717	艾罗能源	200	16,514.00	0.03
282	001359	平安电工	130	16,282.50	0.03
283	301165	锐捷网络	200	16,090.00	0.03
284	000813	德展健康	5,300	16,059.00	0.03
285	601857	中国石油	1,800	15,624.00	0.03

286	688105	诺唯赞	900	15,615.00	0.03
287	600674	川投能源	1,100	15,587.00	0.03
288	688593	新相微	400	15,568.00	0.03
289	300042	朗科科技	200	15,234.00	0.03
290	600246	万通发展	800	15,200.00	0.03
291	688472	阿特斯	1,400	15,148.00	0.03
292	605068	明新旭腾	900	15,102.00	0.03
293	300786	国林科技	600	15,042.00	0.03
294	002245	蔚蓝锂芯	788	14,743.48	0.03
295	002138	顺络电子	200	14,620.00	0.03
296	000061	农产品	2,600	14,560.00	0.03
297	603615	茶花股份	900	14,535.00	0.03
298	601020	华钰矿业	600	14,394.00	0.03
299	301511	德福科技	100	14,385.00	0.03
300	601155	新城控股	1,400	14,364.00	0.03
301	688196	卓越新能	400	14,360.00	0.03
302	603766	隆鑫通用	1,200	14,316.00	0.03
303	300331	苏大维格	200	14,222.00	0.03
304	002975	博杰股份	100	14,200.00	0.03
305	601618	中国中冶	5,800	14,152.00	0.03
306	300938	信测标准	280	13,966.40	0.03
307	600009	上海机场	600	13,860.00	0.03
308	601021	春秋航空	300	13,674.00	0.03
309	688330	宏力达	400	13,532.00	0.03
310	603966	法兰泰克	1,650	13,447.50	0.03
311	603588	高能环境	700	13,440.00	0.03
312	600066	宇通客车	500	13,405.00	0.03
313	300395	菲利华	100	13,373.00	0.03
314	600458	时代新材	800	13,240.00	0.03
315	300236	上海新阳	100	13,150.00	0.03
316	601577	长沙银行	1,500	13,065.00	0.03
317	603223	恒通股份	1,000	13,050.00	0.03
318	002933	新兴装备	500	12,925.00	0.03
319	002346	柘中股份	600	12,834.00	0.02
320	000917	电广传媒	1,900	12,711.00	0.02
321	688097	博众精工	200	12,610.00	0.02
322	601877	正泰电器	500	12,535.00	0.02
323	002810	山东赫达	500	12,350.00	0.02
324	605499	东鹏饮料	100	12,343.00	0.02
325	688776	国光电气	200	12,268.00	0.02
326	600010	包钢股份	5,500	12,265.00	0.02
327	002838	道恩股份	400	12,248.00	0.02
328	600645	中源协和	700	11,977.00	0.02

329	600336	澳柯玛	1,900	11,837.00	0.02
330	688036	传音控股	200	11,790.00	0.02
331	600172	黄河旋风	700	11,760.00	0.02
332	600875	东方电气	400	11,508.00	0.02
333	600893	航发动力	300	11,502.00	0.02
334	601699	潞安环能	800	11,424.00	0.02
335	688786	悦安新材	240	11,059.20	0.02
336	603032	德新科技	400	10,760.00	0.02
337	000572	海马汽车	2,900	10,730.00	0.02
338	601600	中国铝业	1,300	10,686.00	0.02
339	600188	兖矿能源	600	10,662.00	0.02
340	002110	三钢闽光	3,700	10,656.00	0.02
341	600918	中泰证券	2,000	10,640.00	0.02
342	300291	百纳千成	2,200	10,626.00	0.02
343	300676	华大基因	300	10,518.00	0.02
344	600395	盘江股份	2,300	10,488.00	0.02
345	002643	万润股份	500	10,475.00	0.02
346	600418	江淮汽车	400	10,332.00	0.02
347	002436	兴森科技	200	10,190.00	0.02
348	600259	中稀有色	100	10,161.00	0.02
349	603915	国茂股份	700	9,933.00	0.02
350	605111	新洁能	100	9,914.00	0.02
351	603507	振江股份	300	9,867.00	0.02
352	603156	养元饮品	200	9,814.00	0.02
353	002545	东方铁塔	600	9,732.00	0.02
354	601238	广汽集团	1,900	9,652.00	0.02
355	688153	唯捷创芯	300	9,636.00	0.02
356	601169	北京银行	1,900	9,310.00	0.02
357	000552	甘肃能化	4,100	9,184.00	0.02
358	688107	安路科技	200	9,120.00	0.02
359	002625	光启技术	300	9,096.00	0.02
360	600773	西藏城投	700	9,009.00	0.02
361	002192	融捷股份	100	8,940.00	0.02
362	603057	紫燕食品	400	8,920.00	0.02
363	600027	华电国际	2,000	8,900.00	0.02
364	301122	采纳股份	300	8,823.00	0.02
365	300896	爱美客	100	8,720.00	0.02
366	002541	鸿路钢构	500	8,660.00	0.02
367	300671	富满微	100	8,616.00	0.02
368	688182	灿勤科技	200	8,614.00	0.02
369	300629	新劲刚	400	8,584.00	0.02
370	300324	旋极信息	2,300	8,556.00	0.02
371	600061	国投资本	1,300	8,515.00	0.02

372	688469	芯联集成	800	8,488.00	0.02
373	301011	华立科技	600	8,484.00	0.02
374	603185	弘元绿能	500	8,345.00	0.02
375	688568	中科星图	200	8,294.00	0.02
376	002074	国轩高科	300	8,253.00	0.02
377	300821	东岳硅材	400	8,224.00	0.02
378	600118	中国卫星	100	8,205.00	0.02
379	603181	皇马科技	500	8,110.00	0.02
380	301198	喜悦智行	600	8,040.00	0.02
381	601360	三六零	900	7,821.00	0.02
382	001289	龙源电力	500	7,815.00	0.02
383	601088	中国神华	200	7,808.00	0.02
384	301371	敷尔佳	300	7,800.00	0.02
385	000568	泸州老窖	100	7,752.00	0.02
386	002768	国恩股份	148	7,704.88	0.01
387	300863	卡倍亿	100	7,663.00	0.01
388	002947	恒铭达	100	7,605.00	0.01
389	300447	全信股份	500	7,465.00	0.01
390	600320	振华重工	1,800	7,434.00	0.01
391	301193	家联科技	400	7,416.00	0.01
392	002046	国机精工	100	7,365.00	0.01
393	603228	景旺电子	100	7,241.00	0.01
394	601995	中金公司	200	7,230.00	0.01
395	300955	嘉亨家化	200	7,218.00	0.01
396	688302	海创药业	200	7,034.00	0.01
397	605222	起帆电缆	300	6,996.00	0.01
398	600499	科达制造	500	6,900.00	0.01
399	600100	同方股份	1,000	6,850.00	0.01
400	600104	上汽集团	700	6,832.00	0.01
401	600072	中船科技	800	6,792.00	0.01
402	600089	特变电工	300	6,750.00	0.01
403	600105	永鼎股份	100	6,748.00	0.01
404	000895	双汇发展	300	6,720.00	0.01
405	002163	海南发展	800	6,672.00	0.01
406	601878	浙商证券	700	6,650.00	0.01
407	600331	宏达股份	600	6,594.00	0.01
408	600345	长江通信	100	6,551.00	0.01
409	603886	元祖股份	500	6,390.00	0.01
410	301150	中一科技	100	6,311.00	0.01
411	300025	华星创业	1,500	6,300.00	0.01
412	600787	中储股份	1,500	6,270.00	0.01
413	300553	集智股份	100	6,139.00	0.01
414	600497	驰宏锌锗	500	6,055.00	0.01

415	002865	钧达股份	100	5,968.00	0.01
416	300179	四方达	100	5,943.00	0.01
417	301286	侨源股份	100	5,799.00	0.01
418	002943	宇晶股份	130	5,749.90	0.01
419	002716	湖南白银	700	5,663.00	0.01
420	002557	洽洽食品	300	5,388.00	0.01
421	002364	中恒电气	100	5,380.00	0.01
422	603031	安孚科技	100	5,325.00	0.01
423	300747	锐科激光	100	5,309.00	0.01
424	000886	海南高速	1,300	5,304.00	0.01
425	603063	禾望电气	100	5,289.00	0.01
426	300576	容大感光	100	5,122.00	0.01
427	002506	协鑫集成	1,600	5,088.00	0.01
428	600717	天津港	1,300	5,057.00	0.01
429	603606	东方电缆	120	4,981.20	0.01
430	601011	宝泰隆	1,900	4,978.00	0.01
431	300973	立高食品	200	4,914.00	0.01
432	601939	建设银行	500	4,815.00	0.01
433	600887	伊利股份	200	4,792.00	0.01
434	600966	博汇纸业	1,000	4,780.00	0.01
435	600958	东方证券	500	4,720.00	0.01
436	688567	孚能科技	432	4,536.00	0.01
437	000761	本钢板材	2,100	4,515.00	0.01
438	301168	通灵股份	100	4,491.00	0.01
439	601579	会稽山	300	4,407.00	0.01
440	688236	春立医疗	300	4,338.00	0.01
441	600362	江西铜业	100	4,330.00	0.01
442	002885	京泉华	100	4,086.00	0.01
443	601777	千里科技	500	4,080.00	0.01
444	002255	海陆重工	400	3,928.00	0.01
445	300656	民德电子	100	3,809.00	0.01
446	002919	名臣健康	200	3,798.00	0.01
447	600609	金杯汽车	1,200	3,744.00	0.01
448	002158	汉钟精机	100	3,708.00	0.01
449	300393	中来股份	500	3,645.00	0.01
450	600298	安琪酵母	100	3,620.00	0.01
451	603696	安记食品	300	3,450.00	0.01
452	600845	宝信软件	200	3,326.00	0.01
453	603288	海天味业	100	3,316.00	0.01
454	603988	中电电机	200	3,244.00	0.01
455	600184	光电股份	100	3,201.00	0.01
456	603833	欧派家居	100	3,011.00	0.01
457	002001	新 和 成	100	2,842.00	0.01

458	605599	菜百股份	200	2,740.00	0.01
459	300067	安诺其	500	2,710.00	0.01
460	603499	翔港科技	200	2,630.00	0.01
461	001228	永泰运	100	2,555.00	0.00
462	605286	同力天启	100	2,549.00	0.00
463	601608	中信重工	500	2,385.00	0.00
464	300005	探路者	100	2,260.00	0.00
465	300767	震安科技	100	2,229.00	0.00
466	002654	万润科技	100	2,226.00	0.00
467	300497	富祥股份	100	2,216.00	0.00
468	300908	仲景食品	100	2,204.00	0.00
469	001376	百通能源	200	2,080.00	0.00
470	300575	中旗股份	400	1,968.00	0.00
471	002284	亚太股份	200	1,898.00	0.00
472	601456	国联民生	200	1,768.00	0.00
473	601399	国机重装	500	1,750.00	0.00
474	601298	青岛港	200	1,610.00	0.00
475	601969	海南矿业	200	1,582.00	0.00
476	600803	新奥股份	100	1,580.00	0.00
477	600601	方正科技	100	1,384.00	0.00
478	002121	科陆电子	200	1,090.00	0.00
479	600446	金证股份	100	1,006.00	0.00
480	600266	城建发展	200	782.00	0.00
481	000905	厦门港务	100	776.00	0.00
482	002252	上海莱士	100	434.00	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	300750	宁德时代	1,385,134.00	2.54
2	300308	中际旭创	1,283,860.00	2.35
3	688256	寒武纪	1,006,394.00	1.85
4	603986	兆易创新	930,502.00	1.71
5	300502	新易盛	902,273.00	1.65
6	600519	贵州茅台	837,243.00	1.54
7	600900	长江电力	745,835.00	1.37
8	688041	海光信息	719,032.30	1.32
9	601318	中国平安	656,624.00	1.20
10	603259	药明康德	620,366.00	1.14
11	002415	海康威视	608,871.00	1.12
12	688012	中微公司	593,109.47	1.09
13	603993	洛阳钼业	582,578.00	1.07
14	688008	澜起科技	564,631.43	1.04

15	000333	美的集团	564,147.00	1.03
16	601009	南京银行	563,555.00	1.03
17	300476	胜宏科技	562,680.07	1.03
18	000975	山金国际	543,862.00	1.00
19	300394	天孚通信	529,910.00	0.97
20	002463	沪电股份	529,759.00	0.97

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	300750	宁德时代	1,541,468.00	2.83
2	600519	贵州茅台	1,417,274.00	2.60
3	300308	中际旭创	1,164,228.00	2.14
4	601318	中国平安	1,140,691.00	2.09
5	300502	新易盛	1,085,632.91	1.99
6	601899	紫金矿业	1,083,239.00	1.99
7	000333	美的集团	897,354.00	1.65
8	603986	兆易创新	803,409.00	1.47
9	002475	立讯精密	774,436.00	1.42
10	688256	寒武纪	773,908.00	1.42
11	688008	澜起科技	765,931.76	1.40
12	603259	药明康德	759,462.00	1.39
13	688041	海光信息	720,940.61	1.32
14	000338	潍柴动力	685,126.00	1.26
15	600030	中信证券	680,882.00	1.25
16	600150	中国船舶	668,652.00	1.23
17	600036	招商银行	642,763.00	1.18
18	600188	兖矿能源	637,599.00	1.17
19	600309	万华化学	618,044.00	1.13
20	600276	恒瑞医药	613,078.40	1.12

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	122,009,248.18
卖出股票收入（成交）总额	130,644,333.32

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

本基金现阶段主要通过股指期货有效对冲持有股票的系统性风险。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理和风险控制的原则，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金通过对现货和期货市场相关性研究，计算需要的股指期货合约数量，并根据不同期货合约定价关系、保证金要求、流动性情况等因素，对股指期货合约数量及配比进行动态调整，寻求与现货资产的匹配，力争构建市场中性投资组合并获得稳定的正向超额收益。

随着监管的放开及融资、融券等其他对冲工具的优势增强，本基金会优选空头工具，采用最优的多头系统性风险剥离方式。

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和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 28,967,978.65 元，占基金资产净值的比例为 56.06%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-27,643,860.00 元，占基金资产净值的比例为-53.49%，空头合约市值占股票资产的比例为-95.43%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-105,818.53 元，公允价值变动损益为 1,123,561.99 元。

7.13 投资组合报告附注

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

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

7.13.2 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。

7.13.3 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	3,332,187.13
2	应收清算款	570,287.84
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,902,474.97

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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	6,230	6,425.46	10,001,000.10	24.98	30,029,623.36	75.02

量化对冲策略三个月定期开放混合 A						
景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 C	5	1,960,998.52	9,804,882.83	100.00	109.78	-
合计	6,235	7,992.88	19,805,882.93	39.74	30,029,733.14	60.26

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（%）	93.47

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	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 A	1,053,383.36	2.631444
	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 C	99.91	0.001019
	合计	1,053,483.27	2.113916

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	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 A	>100
	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 C	-
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 A	>100
	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 C	-
	合计	>100

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,000.10	20.07	10,000,000.00	0.36	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,001,000.10	20.07	10,000,000.00	0.36	—

注：发起份额总数为不包含利息的认购份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 A	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 C
基金合同生效日 (2020 年 2 月 27 日) 基金份额总额	2,803,947,219.94	—
本报告期期初基金份额总额	43,670,101.27	9,804,992.61
本报告期基金总申购份额	253,575.29	96.78
减：本报告期基金总赎回份额	3,893,053.10	96.78
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	40,030,623.46	9,804,992.61

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金财产、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

本基金本报告期末未更换会计师事务所。

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

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大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(%)	
东方证券股份有限公司	3	252,653,581.50	100.00	24,229.19	100.00	未变更
北京证券有限责任公司	2	-	-	-	-	未变更

公司						
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
高盛（中国）证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国联民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国盛证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国泰海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更

国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
开源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	本期报告退租 1 个
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	未变更
太平洋证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
天风证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
招商证券股份有限公司	4	-	-	-	-	未变更
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中国银河	1	-	-	-	-	未变

证券股份有限公司						更
中航证券 有限公司	2	-	-	-	-	未变 更
中泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
中信建投 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	未变 更
中信证券 股份有限 公司	5	-	-	-	-	未变 更
中银国际 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	未变 更
中邮证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	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(%)
东方证券股份有限公司	4,116.40	100.00	-	-	-	-
北京证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
第一创业 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
高盛（中 国）证券有 限责任公 司	-	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国都证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国海证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国联民生 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任	-	-	-	-	-	-

公司						
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
中信建投 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中邮证券 有限责任 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	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 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旗下部分基金新增华西证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 5 日
6	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2026 年 2 月 9 日至 2026 年 2 月 13 日第二十四个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 7 日
7	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2026 年 2 月 9 日至 2026 年 2 月 13 日第二十四个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 9 日
8	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
9	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

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	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 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	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 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
19	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
20	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2026 年 5 月 8 日至 2026 年 5 月 14 日第二十五个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 6 日
21	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2026 年 5 月 8 日至 2026 年 5 月 14 日第二十五个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 7 日
22	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2026 年 5 月 8 日至 2026 年 5 月 14 日第二十五个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 8 日
23	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	2026 年 5 月 12 日

	停机维护的通知	网站	
24	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
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终止中证金牛（北京）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	2026 年 5 月 29 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 2 日
30	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
31	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增长江证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 12 日
32	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
33	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
34	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（%）
机构	1	20260514-20260630	10,001,000.10	-	-	10,001,000.10	20.07
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：							
1、大额申购风险							
在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。							

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

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

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

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

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

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

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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录**12.1 备查文件目录**

1、中国证监会准予景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；

2、《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》；

4、《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式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