

景顺长城成长之星股票型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22

§ 8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	56
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	56
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	56
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
8.12 投资组合报告附注.....	57
§ 9 基金份额持有人信息	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	58
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	58
§ 10 开放式基金份额变动	58
§ 11 重大事件揭示	59
11.1 基金份额持有人大会决议.....	59
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
11.4 基金投资策略的改变.....	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
11.8 其他重大事件.....	62
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	68
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
§ 13 备查文件目录	68
13.1 备查文件目录.....	68
13.2 存放地点.....	68
13.3 查阅方式.....	69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城成长之星股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城成长之星股票
场内简称	无
基金主代码	000418
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 13 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	100,459,301.51 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在中国经济转型的大背景下，深度挖掘具备未来增长潜力的产业趋势和受益企业进行投资，在有效控制风险的基础上实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置：本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>2、股票投资策略：本基金股票投资主要遵循“自下而上”的个股投资策略，利用基金管理人股票研究数据库（SRD）对企业内在价值进行深入细致的分析，并进一步挖掘出质地优秀，未来预期成长性良好的上市公司股票进行投资。</p> <p>3、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。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数×90%+中证全债指数×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中风险程度较高的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国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	北京市西城区复兴门内大街 55

	建设广场第一座 21 层	号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	李进	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	83,412,798.08	18,528,880.12	-9,103,585.39
本期利润	164,944,647.84	40,561,725.86	-17,274,445.68
加权平均基金份额本期利润	1.4411	0.9071	-0.4307
本期加权平均净值利润率	44.80%	48.10%	-26.27%
本期基金份额净值增长率	75.52%	68.30%	-23.31%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	231,534,201.47	70,646,814.70	16,154,707.48
期末可供分配基金份额利润	2.3048	1.3038	0.3688
期末基金资产净值	406,299,517.50	124,830,490.57	59,963,755.10
期末基金份额净值	4.044	2.304	1.369
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	304.40%	130.40%	36.90%

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

除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

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

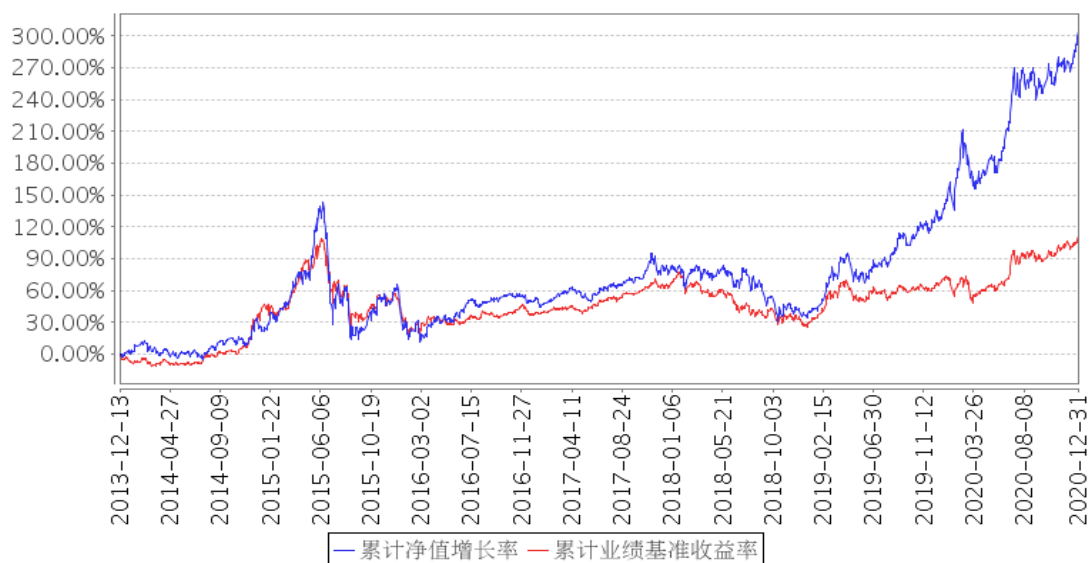
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	15.74%	1.14%	12.34%	0.89%	3.40%	0.25%
过去六个月	26.81%	1.49%	22.57%	1.21%	4.24%	0.28%
过去一年	75.52%	1.79%	24.86%	1.29%	50.66%	0.50%
过去三年	126.55%	1.68%	28.88%	1.21%	97.67%	0.47%
过去五年	150.71%	1.60%	38.76%	1.12%	111.95%	0.48%
自基金合同生效起至今	304.40%	1.82%	111.31%	1.33%	193.09%	0.49%

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

景顺长城成长之星股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

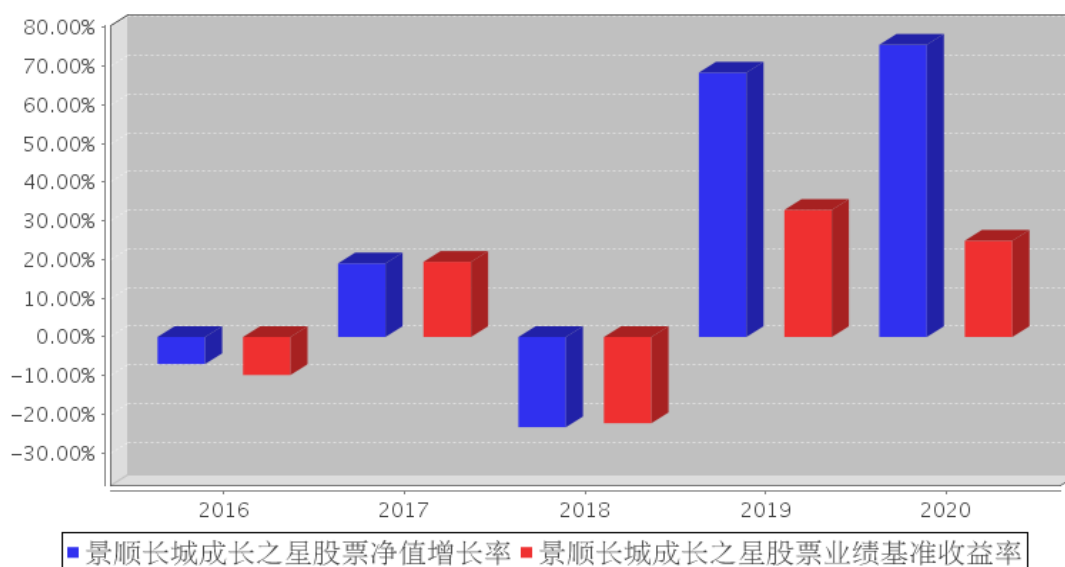


注：本基金的投资组合比例为：本基金将基金资产的 80%-95% 投资于股票资产，其中，投资于

成长性良好的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，将不超过 20% 的基金资产投资于债券等固定收益类品种，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2013 年 12 月 13 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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城成长之星股票基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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“公司”或“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。

截至2020年12月31日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理111只开放式基金，包括景

顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金 (LOF)、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金 (LOF)、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金 (QDII)、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证科技传媒通信 150 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证科技传媒通信 150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化小盘股票型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投

资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金、景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景泰鑫利纯债债券型证券投资基金、景顺长城智能生活混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金、景顺长城集英成长两年定期开放混合型证券投资基金、景顺长城量化港股通股票型证券投资基金、景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金、景顺长城绩优成长混合型证券投资基金、景顺长城中短债债券型证券投资基金、景顺长城中证沪港深红利成长低波动指数型证券投资基金、景顺长城稳健养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城创新成长混合型证券投资基金、景顺长城景泰纯利债券型证券投资基金、景顺长城养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城弘利 39 个月定期开放债券型证券投资基金、景顺长城品质成长混合型证券投资基金、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、景顺长城泰申回报混合型证券投资基金、景顺长城科技创新混合型证券投资基金、景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金、景顺长城景泰裕利纯债债券型证券投资基金、景顺长城核心优选一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城创业板综指增强型证券投资基金、景顺长城成长领航混合型证券投资基金、景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城安鑫回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城弘远 66 个月定期开放债券型证券投资基金、景顺长城价值稳进三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城竞争优势混合型证券投资基金、景顺长城景泰添利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、景顺长城价值边际灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城电子信息产业股票型证券投资基金、景顺长城消费精选混合型证券投资基金、景顺长城中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、景顺长城景颐招利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城顺鑫回报混合型证券投资基金、景顺长城景泰宝利一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金、景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金、景顺长城核心中景一年持有期混合型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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		
刘晓明	本基金的基金经理	2015年3月28日	2020年5月20日	12年	农学硕士。曾担任国元证券研究所研究员，第一创业证券研究所行业研究员。2011年6月加入本公司，历任研究部研究员、高级研究员，自2014年11月起担任股票投资部基金经理。
邓敬东	本基金的基金经理	2020年5月21日	-	9年	金融学硕士。曾担任上海申银万国证券研究所高级分析师。2015年5月加入本公司，历任研究部研究员、基金经理助理，自2020年5月起担任股票投资部基金经理。
周寒颖	本基金的基金经理	2020年5月21日	-	14年	管理学硕士。曾担任招商基金研究部研究员和高级研究员、国际业务部高级研究员等职务。2015年7月加入本公司，担任研究部高级研究员，自2016年6月起担任国际投资部基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

暂无兼任情况。

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、《景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法

律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

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

2、交易执行的内部控制

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

3、交易指令分配的控制

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

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

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理与绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年

度报告中对此做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易现象。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本期暂无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金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 27 次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，公司旗下指数基金因指数成份股调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间虽然存在交易所证券临近交易日同向交易和银行间债券 5 日内反向交易，但结合交易时机及市场交易价格波动分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。

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

2020 年全年上证指数上涨 13.87%，深证成指上涨 38.73%，创业板指上涨 64.96%。

本基金重点关注了新兴行业中发展前景好增速快，且估值合理的公司；投资的新兴行业主要包括电子行业、通信行业、计算机行业、医药生物行业、游戏、光伏、新能源汽车、互联网金融等，也包含了汽车、建材、食品饮料等传统行业中有新品创新符合产业发展趋势的标的。进口替代、数字化转型、消费升级是三个大的投资方向。成长之星将继续积极在新经济领域，包括新业态、新模式、新产业、新技术赛道上通过长期跟踪和独特产业视角，选择出优秀的团队，与他们一同分享行业成长的红利和公司阿尔法收益。组合管理上通过更加精细化、多元化、灵活而均衡的行业配置来实现下行风险的控制。

政治方面，2020 年美国大选落地，拜登当选。中国和其他 14 个亚太国家签署了 RCEP 协定，关税在未来将明显下降。中国十四五顺利召开，中央经济工作会议设定 2021 年政策基调，提出 2021 年政策“不急转弯”。具体来看：1) 强调推动高质量发展和扩大内需；2) 防风险、反垄断、

发展租赁住房市场；3) 创新与自主可控；4) 碳达峰与碳中和。产业政策方面，国内关于平台经济领域的反垄断指南公布，冠脉支架集采大幅降价靴子落地。经济方面，国企债务违约事件引起广泛关注，引发市场对信贷可能收紧的忧虑。英国出现病毒新变种、加强封锁措施；多个国家暂停通航。美国第三波疫情严重程度要甚于过去一轮。海外经济仍处在持续恢复状态之中，11 月全球制造业 PMI 继续抬升至 53.7，并呈现供需两旺的状态。美国 11 月份的非农就业数据弱于市场预期。但以上两个负面因素在近期可能都出现了边际变化，一方面是疫苗研发频传佳音，市场预期发达经济体能够在 2021 年年中左右实现群体免疫，后续的风险点在于接种率以及病毒变异的情况；另一方面，9000 亿美元的新一轮财政刺激计划最终落地，一次性补贴 600 美元、失业补贴降至 300 美元/周，将一次性补贴提升至 2000 美元的议案也已在众议院通过。美联储 12 月 FOMC：将 QE 指引从此前的时间指引“未来数月”改为目标指引“直到充分就业和通胀目标实现重大进展”。继续 1200 亿美元/月的购债节奏并强调维持政策对经济的支持，而从美联储等发达经济体央行资产负债表规模的同比增速来看，即便不考虑政策退出 2021 年也将会明显回落，这对于权益市场估值可能形成一定压力，这也是 A 股市场的外在风险之一。

风险：1. 估值过高是市场核心风险点，流动性收紧将对现有估值体系产生冲击，波动加剧。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2020 年度，本基金份额净值增长率为 75.52%，业绩比较基准收益率为 24.86%。

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 2021 年，基数效应下，经济增速预计前高后低，制造业投资、出口、消费会是经济增长的边际驱动因素。针对房地产的贷款集中度管理，会限制部分银行的按揭贷款和开发贷额度；短期来看，购房需求较强、低基较低，销售和投资仍会高增，但预计后续会逐步回落，全年同比相对平稳。但制造业投资和出口呈现良好态势，后续伴随疫苗进展，消费出行等也会恢复，市场存在结构性机会。

政策层面，考虑到 2020 年宏观杠杆率上升较快，以及疫情有所控制，预计 2021 年流动性会较去年非常宽松的状态边际收紧。但不确定的是收紧的幅度和速度。预计全年新增信贷还会维持 18-20 万亿的体量。其中，对房地产的贷款有所收紧，对实体的支持力度不会太弱。后续重点观察通胀变化，如果通胀上升太快，不排除进一步收紧的可能。总的来说，2020 年市场机会主要靠盈利驱动，政策边际收紧，估值很难提升，我们会更多关注盈利边际改善的公司。从上下半年的角度，上半年重点把握盈利改善的方向，下半年可能会转向防守配置。

微观流动性层面，居民资产权益配置比例仍不算高，2020 年股票型基金规模翻倍，也不过 6 万亿的体量，在居民 100 多万亿资产里的占比仍不算高，未来还有提升空间。如果这个趋势能够

持续，也会对市场形成有力支撑。

当然，市场也在动态变化，我们也会紧密跟踪经济和公司基本面变化，来相机抉择。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

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

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

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

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

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

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后

续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告**5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，本基金托管人在对景顺长城成长之星股票型证券投资基金的托管过程中，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，景顺长城成长之星股票型证券投资基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在景顺长城成长之星股票型证券投资基金的投资运作、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城成长之星股票型证券投资基金 2020 年年度报告中财务指标、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 审计报告**6.1 审计报告基本信息**

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 21316 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城成长之星股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城成长之星股票型证券投资基金(以下简称“景顺长城成长之星基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业</p>

	<p>实务操作编制，公允反映了景顺长城成长之星基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城成长之星基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>景顺长城成长之星基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估景顺长城成长之星基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算景顺长城成长之星基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督景顺长城成长之星基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对景顺长城成长之星基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用</p>

	者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城成长之星基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	陈薇瑶
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2021 年 3 月 24 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城成长之星股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	26,865,690.93	13,185,458.09
结算备付金		232,646.76	463,908.80
存出保证金		94,251.58	46,423.34
交易性金融资产	7.4.7.2	374,789,731.14	114,531,559.99
其中：股票投资		373,711,481.34	114,403,129.89
基金投资		-	-
债券投资		1,078,249.80	128,430.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		9,003,071.48	-
应收利息	7.4.7.5	3,264.91	2,973.96
应收股利		-	-
应收申购款		1,275,385.66	737,414.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		412,264,042.46	128,967,738.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日

负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,475,150.78
应付赎回款		4,865,471.29	1,197,864.28
应付管理人报酬		510,441.86	150,749.69
应付托管费		85,073.65	25,124.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	224,842.91	157,550.78
应交税费		4.16	0.54
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	278,691.09	130,806.59
负债合计		5,964,524.96	4,137,247.62
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	100,459,301.51	54,183,675.87
未分配利润	7.4.7.10	305,840,215.99	70,646,814.70
所有者权益合计		406,299,517.50	124,830,490.57
负债和所有者权益总计		412,264,042.46	128,967,738.19

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 4.044 元，基金份额总额 100,459,301.51 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城成长之星股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		175,190,669.51	43,292,072.74
1. 利息收入		212,609.16	82,099.24
其中：存款利息收入	7.4.7.11	195,615.94	71,657.67
债券利息收入		419.53	316.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		16,573.69	10,125.29
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		91,143,039.62	20,915,126.14
其中：股票投资收益	7.4.7.12	87,632,883.08	20,133,620.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	24,282.78	186,288.52
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	3,485,873.76	595,216.96
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	81,531,849.76	22,032,845.74
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,303,170.97	262,001.62
减：二、费用		10,246,021.67	2,730,346.88
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,458,977.88	1,260,041.10
2. 托管费	7.4.10.2.2	909,829.74	210,006.81
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	3,678,217.50	1,116,537.84
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1.55	1.13
7. 其他费用	7.4.7.19	198,995.00	143,760.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		164,944,647.84	40,561,725.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		164,944,647.84	40,561,725.86

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城成长之星股票型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	54,183,675.87	70,646,814.70	124,830,490.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	164,944,647.84	164,944,647.84

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	46,275,625.64	70,248,753.45	116,524,379.09
其中：1. 基金申购款	241,160,082.13	490,672,708.13	731,832,790.26
2. 基金赎回款	-194,884,456.49	-420,423,954.68	-615,308,411.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	100,459,301.51	305,840,215.99	406,299,517.50
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	43,809,047.62	16,154,707.48	59,963,755.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	40,561,725.86	40,561,725.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	10,374,628.25	13,930,381.36	24,305,009.61
其中：1. 基金申购款	52,218,697.97	53,286,842.69	105,505,540.66
2. 基金赎回款	-41,844,069.72	-39,356,461.33	-81,200,531.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	54,183,675.87	70,646,814.70	124,830,490.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城成长之星股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1361号《关于核准景顺长城成长之星股票型证券投资基金募集的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》

和《景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 535,635,270.28 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(2013)第 794 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 535,770,185.52 份基金份额，其中认购资金利息折合 134,915.24 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、债券(包括中小企业私募债券)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金将基金资产的 80%-95%投资于股票资产，其中，投资于成长性良好的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，将不超过 20%的基金资产投资于债券等固定收益类品种，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×90%+中证全债指数×10%。

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 2021 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的

金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券投资在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部

分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	26,865,690.93	13,185,458.09
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月至1年	-	-
存款期限1年以上	-	-
其他存款	-	-
合计	26,865,690.93	13,185,458.09

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	276,760,212.98	373,711,481.34	96,951,268.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,078,249.80	409,249.80
	银行间市场	-	-
	合计	1,078,249.80	409,249.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	277,429,212.98	374,789,731.14	97,360,518.16
项目	上年度末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	98,574,846.66	114,403,129.89	15,828,283.23
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	128,430.10	385.17
	银行间市场	-	-
	合计	128,430.10	385.17
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	98,702,891.59	114,531,559.99	15,828,668.40

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	2,704.15	2,723.70
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	104.70	208.70
应收债券利息	413.66	20.66
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	42.40	20.90
合计	3,264.91	2,973.96

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	224,842.91	157,550.78
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	224,842.91	157,550.78

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	14,191.09	1,306.59
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	264,500.00	129,500.00
合计	278,691.09	130,806.59

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,183,675.87	54,183,675.87
本期申购	241,160,082.13	241,160,082.13
本期赎回（以“-”号填列）	-194,884,456.49	-194,884,456.49
- 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	100,459,301.51	100,459,301.51

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	80,440,757.63	-9,793,942.93	70,646,814.70
本期利润	83,412,798.08	81,531,849.76	164,944,647.84
本期基金份额交易产生的变动数	67,680,645.76	2,568,107.69	70,248,753.45
其中：基金申购款	438,368,973.93	52,303,734.20	490,672,708.13
基金赎回款	-370,688,328.17	-49,735,626.51	-420,423,954.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	231,534,201.47	74,306,014.52	305,840,215.99

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	176,561.46	65,974.15
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	16,930.32	4,870.13
其他	2,124.16	813.39

合计	195,615.94	71,657.67
----	------------	-----------

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	1,160,830,755.24	362,156,006.19
减：卖出股票成本总额	1,073,197,872.16	342,022,385.53
买卖股票差价收入	87,632,883.08	20,133,620.66

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	223,610.69	1,986,038.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	199,137.27	1,798,644.67
减：应收利息总额	190.64	1,105.21
买卖债券差价收入	24,282.78	186,288.52

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,485,873.76	595,216.96
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	3,485,873.76	595,216.96

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	81,531,849.76	22,032,845.74
股票投资	81,122,985.13	22,032,460.57
债券投资	408,864.63	385.17
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	81,531,849.76	22,032,845.74

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	1,896,406.95	211,875.55
基金转换费收入	406,764.02	50,126.07
合计	2,303,170.97	262,001.62

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	3,678,217.50	1,116,537.84
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,678,217.50	1,116,537.84

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	60,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行划款手续费	995.00	760.00
合计	198,995.00	143,760.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国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
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
长城证券	-	-	3,883,279.65	0.53

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
长城证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
长城证券	3,616.45	0.53	3,616.45	2.30

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,458,977.88	1,260,041.10
其中：支付销售机构的客户维护费	2,260,000.65	595,830.69

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	909,829.74	210,006.81

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

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国工商银行-活期	26,865,690.93	176,561.46	13,185,458.09

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷	2020年12月	2021年1	新股流	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-

	电子	24 日	月 4 日	通受限						
300860	锋尚文化	2020 年 8 月 6 日	2021 年 2 月 24 日	新股流通受限	138.02	126.67	133	18,356.66	16,847.11	-
300861	美畅股份	2020 年 8 月 6 日	2021 年 2 月 24 日	新股流通受限	43.76	51.10	382	16,716.32	19,520.20	-
300862	蓝盾光电	2020 年 8 月 7 日	2021 年 3 月 4 日	新股流通受限	33.95	38.54	5,843	198,369.85	225,189.22	-
300864	南大环境	2020 年 8 月 13 日	2021 年 2 月 25 日	新股流通受限	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300867	圣元环保	2020 年 8 月 12 日	2021 年 3 月 3 日	新股流通受限	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-
300868	杰美特	2020 年 8 月 12 日	2021 年 2 月 24 日	新股流通受限	41.26	43.28	571	23,559.46	24,712.88	-
300872	天阳科技	2020 年 8 月 14 日	2021 年 2 月 25 日	新股流通受限	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	-
300873	海晨股份	2020 年 8 月 14 日	2021 年 3 月 2 日	新股流通受限	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300877	金春股份	2020 年 8 月 17 日	2021 年 3 月 3 日	新股流通受限	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300878	维康药业	2020 年 8 月 17 日	2021 年 3 月 3 日	新股流通受限	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300879	大叶股份	2020 年 8 月 25 日	2021 年 3 月 1 日	新股流通受限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300886	华业香料	2020 年 9 月 8 日	2021 年 3 月 16 日	新股流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300887	谱尼测试	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股流通受限	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300889	爱克股份	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股流通受限	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 18 日	新股流通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 17 日	新股流通受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020 年 9 月 11 日	2021 年 3 月 24 日	新股流通受限	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300893	松原股份	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股流通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300894	火星	2020 年 12 月 24 日	2021 年 6 月 30 日	新股流通受限	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300895	铜牛信息	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股流通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020 年 9 月 21 日	2021 年 3 月 29 日	新股流通受限	118.27	603.36	161	19,041.47	97,140.96	-

300898	熊猫乳品	2020年10月9日	2021年4月16日	新股流通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300900	广联航空	2020年10月19日	2021年4月29日	新股流通受限	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300902	国安达	2020年10月22日	2021年4月29日	新股流通受限	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	新股流通受限	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300909	汇创达	2020年11月11日	2021年5月18日	新股流通受限	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月3日	新股流通受限	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	新股流通受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	新股流通受限	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新股流通受限	24.60	61.51	497	12,226.20	30,570.47	-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新股流通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年6月30日	新股流通受限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年1月7日	新股流通受限	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300999	金龙鱼	2020年9月29日	2021年4月15日	新股流通受限	25.70	88.29	2,514	64,609.80	221,961.06	-
601995	中金公司	2020年10月22日	2021年5月6日	新股流通受限	28.78	68.71	24,951	718,089.78	1,714,383.21	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688017	绿的谐波	2020年8月21日	2021年3月1日	新股流通受限	35.06	137.81	4,138	145,078.28	570,257.78	-
688069	德林海	2020年7月15日	2021年1月22日	新股流通受限	67.20	62.45	2,253	151,401.60	140,699.85	-
688133	泰坦科技	2020年10月22日	2021年4月30日	新股流通受限	44.47	116.54	2,527	112,375.69	294,496.58	-
688156	路德环境	2020年9月14日	2021年3月22日	新股流通受限	15.91	20.07	2,602	41,397.82	52,222.14	-
688179	阿拉丁	2020年10月16日	2021年4月26日	新股流通受限	19.43	64.24	3,944	76,631.92	253,362.56	-
688488	艾迪	2020年7月9日	2021年1月	新股流	13.99	24.48	9,934	138,976.66	243,184.32	-

	药业	日	月 20 日	通受限						
688560	明冠新材	2020 年 12 月 16 日	2021 年 6 月 24 日	新股流通受限	15.87	22.86	3,832	60,813.84	87,599.52	-
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 7 日	新股流通受限	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688699	明微电子	2020 年 12 月 10 日	2021 年 6 月 18 日	新股流通受限	38.43	45.27	1,869	71,825.67	84,609.63	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制

流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.27%（上年末：0.10%）。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

险。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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							
银行存款	26,865,690.93	-	-	-	-	-	26,865,690.93
结算备付金	232,646.76	-	-	-	-	-	232,646.76
存出保证金	94,251.58	-	-	-	-	-	94,251.58
交易性金融资产	-	-	-	-	1,078,249.80	373,711,481.34	374,789,731.14
应收利息	-	-	-	-	-	3,264.91	3,264.91
应收申购款	-	-	-	-	-	1,275,385.66	1,275,385.66
应收证券清算款	-	-	-	-	-	9,003,071.48	9,003,071.48
资产总计	27,192,589.27	-	-	-	1,078,249.80	383,993,203.39	412,264,042.46
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,865,471.29	4,865,471.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	510,441.86	510,441.86
应付托管费	-	-	-	-	-	85,073.65	85,073.65
应付交易费用	-	-	-	-	-	224,842.91	224,842.91
应交税费	-	-	-	-	-	4.16	4.16
其他负债	-	-	-	-	-	278,691.09	278,691.09
负债总计	-	-	-	-	-	5,964,524.96	5,964,524.96
利率敏感	27,192,589.27	-	-	-	1,078,249.80	-	-

度缺口							
上年度末 2019 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							
银行存款	13,185,458.09	-	-	-	-	-	13,185,458.09
结算备付金	463,908.80	-	-	-	-	-	463,908.80
存出保证金	46,423.34	-	-	-	-	-	46,423.34
交易性金融资产	-	-	-	-	128,430.10	114,403,129.89	114,531,559.99
应收利息	-	-	-	-	-	2,973.96	2,973.96
应收申购款	-	-	-	-	-	737,414.01	737,414.01
资产总计	13,695,790.23	-	-	-	128,430.10	115,143,517.86	128,967,738.19
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,197,864.28	1,197,864.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	150,749.69	150,749.69
应付托管费	-	-	-	-	-	25,124.96	25,124.96
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,475,150.78	2,475,150.78
应付交易费用	-	-	-	-	-	157,550.78	157,550.78
应交税费	-	-	-	-	-	0.54	0.54
其他负债	-	-	-	-	-	130,806.59	130,806.59
负债总计	-	-	-	-	-	4,137,247.62	4,137,247.62
利率敏感度缺口	13,695,790.23	-	-	-	128,430.10	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.27%（上年末：0.10%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。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。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019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	373,711,481.34	91.98	114,403,129.89	91.65
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	373,711,481.34	91.98	114,403,129.89	91.65

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深300指数”以外的其他市场变量保持不变		
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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）	
分析	沪深300指数上升5%	21,007,064.37	6,090,454.89
	沪深300指数下降5%	-21,007,064.37	-6,090,454.89

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 370,086,307.01 元，属于第二层次的余额为 4,703,424.13 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 114,400,981.95 元，第二层次 130,578.04 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	373,711,481.34	90.65
	其中：股票	373,711,481.34	90.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,078,249.80	0.26
	其中：债券	1,078,249.80	0.26
	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	27,098,337.69	6.57
8	其他各项资产	10,375,973.63	2.52
9	合计	412,264,042.46	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	268,796,559.06	66.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	8,578,217.17	2.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,958,901.78	2.20
J	金融业	63,787,650.21	15.70
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	563,508.34	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	255,894.15	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	22,728,605.66	5.59
R	文化、体育和娱乐业	16,847.11	0.00
S	综合	-	-
	合计	373,711,481.34	91.98

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	---------	-----------

					(%)
1	600176	中国巨石	1,584,120	31,619,035.20	7.78
2	000333	美的集团	305,700	30,093,108.00	7.41
3	300059	东方财富	941,629	29,190,499.00	7.18
4	000858	五粮液	79,800	23,289,630.00	5.73
5	002475	立讯精密	403,023	22,617,650.76	5.57
6	600660	福耀玻璃	371,000	17,826,550.00	4.39
7	300760	迈瑞医疗	36,800	15,676,800.00	3.86
8	601318	中国平安	160,700	13,977,686.00	3.44
9	603806	福斯特	141,500	12,084,100.00	2.97
10	603882	金域医学	80,400	10,300,848.00	2.54
11	601838	成都银行	959,100	10,233,597.00	2.52
12	600741	华域汽车	315,122	9,081,816.04	2.24
13	300014	亿纬锂能	109,900	8,956,850.00	2.20
14	300394	天孚通信	163,793	8,735,080.69	2.15
15	601166	兴业银行	415,500	8,671,485.00	2.13
16	002600	领益智造	713,500	8,554,865.00	2.11
17	688116	天奈科技	132,782	8,232,484.00	2.03
18	002271	东方雨虹	189,450	7,350,660.00	1.81
19	600276	恒瑞医药	60,620	6,756,705.20	1.66
20	300888	稳健医疗	40,700	6,756,200.00	1.66
21	603920	世运电路	255,700	6,689,112.00	1.65
22	600763	通策医疗	23,900	6,608,828.00	1.63
23	300347	泰格医药	36,006	5,818,929.66	1.43
24	603444	吉比特	10,700	4,558,200.00	1.12
25	000902	新洋丰	281,500	4,504,000.00	1.11
26	002352	顺丰控股	50,823	4,484,113.29	1.10
27	600104	上汽集团	183,100	4,474,964.00	1.10
28	300725	药石科技	29,700	4,098,600.00	1.01
29	601021	春秋航空	73,500	4,074,105.00	1.00
30	300630	普利制药	90,830	3,804,868.70	0.94
31	603456	九洲药业	104,400	3,737,520.00	0.92
32	000725	京东方A	619,300	3,715,800.00	0.91
33	603236	移远通信	18,900	3,533,166.00	0.87
34	002405	四维图新	246,800	3,521,836.00	0.87
35	300747	锐科激光	30,100	2,644,586.00	0.65
36	600486	扬农化工	16,401	2,164,932.00	0.53
37	300034	钢研高纳	58,600	2,106,670.00	0.52
38	000550	江铃汽车	91,500	1,888,560.00	0.46
39	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.42
40	002906	华阳集团	56,200	1,515,152.00	0.37
41	300408	三环集团	38,100	1,419,225.00	0.35

42	688063	派能科技	3,050	788,791.00	0.19
43	688017	绿的谐波	4,138	570,257.78	0.14
44	688686	奥普特	1,903	412,570.40	0.10
45	688777	中控技术	4,092	410,018.40	0.10
46	300919	中伟股份	4,965	395,695.43	0.10
47	688608	恒玄科技	1,194	395,214.00	0.10
48	300894	火星人	6,279	300,116.16	0.07
49	688133	泰坦科技	2,527	294,496.58	0.07
50	688157	松井股份	3,402	282,366.00	0.07
51	688179	阿拉丁	3,944	253,362.56	0.06
52	688488	艾迪药业	9,934	243,184.32	0.06
53	300862	蓝盾光电	5,843	225,189.22	0.06
54	300999	金龙鱼	2,514	221,961.06	0.05
55	688095	福昕软件	886	214,412.00	0.05
56	688510	航亚科技	5,991	212,261.13	0.05
57	688069	德林海	2,253	140,699.85	0.03
58	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.03
59	300918	南山智尚	10,626	123,398.55	0.03
60	300896	爱美客	161	97,140.96	0.02
61	688560	明冠新材	3,832	87,599.52	0.02
62	688699	明微电子	1,869	84,609.63	0.02
63	688590	新致软件	4,171	82,168.70	0.02
64	688156	路德环境	2,602	52,222.14	0.01
65	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.01
66	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.01
67	300900	广联航空	879	29,147.64	0.01
68	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
69	300877	金春股份	569	28,933.65	0.01
70	300868	杰美特	571	24,712.88	0.01
71	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.01
72	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
73	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
74	300861	美畅股份	382	19,520.20	0.00
75	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
76	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
77	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
78	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
79	300860	锋尚文化	133	16,847.11	0.00
80	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
81	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
82	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
83	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00

84	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
85	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
86	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
87	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
88	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
89	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
90	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
91	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
92	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
93	003004	声迅股份	306	9,984.78	0.00
94	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
95	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
96	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
97	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
98	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
99	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
100	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
101	605151	西上海	23	484.15	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300115	长盈精密	28,677,610.19	22.97
2	300059	东方财富	20,713,495.72	16.59
3	000333	美的集团	20,460,259.00	16.39
4	600131	国网信通	19,987,242.00	16.01
5	600176	中国巨石	19,755,271.26	15.83
6	000401	冀东水泥	19,407,750.05	15.55
7	002544	杰赛科技	19,247,439.99	15.42
8	603019	中科曙光	19,190,376.95	15.37
9	000538	云南白药	18,580,027.41	14.88
10	000858	五粮液	18,122,724.27	14.52
11	300347	泰格医药	17,621,045.00	14.12
12	000158	常山北明	17,295,194.70	13.85
13	603986	兆易创新	17,223,479.14	13.80
14	002212	天融信	17,076,375.28	13.68
15	000063	中兴通讯	16,680,287.40	13.36
16	300083	创世纪	16,343,626.00	13.09
17	300037	新宙邦	15,954,584.00	12.78
18	600276	恒瑞医药	15,230,129.02	12.20

19	300078	思创医惠	14,739,847.75	11.81
20	000877	天山股份	14,638,947.86	11.73
21	000725	京东方 A	14,550,502.00	11.66
22	600546	山煤国际	14,159,852.00	11.34
23	601838	成都银行	13,951,371.00	11.18
24	300737	科顺股份	13,377,472.20	10.72
25	601012	隆基股份	12,860,990.19	10.30
26	300073	当升科技	12,573,308.00	10.07
27	600459	贵研铂业	12,565,983.81	10.07
28	601318	中国平安	12,529,890.80	10.04
29	300010	豆神教育	12,433,132.05	9.96
30	603806	福斯特	11,708,606.38	9.38
31	600216	浙江医药	11,632,133.44	9.32
32	300394	天孚通信	11,573,226.94	9.27
33	300383	光环新网	11,515,381.00	9.22
34	002824	和胜股份	11,435,041.50	9.16
35	300603	立昂技术	11,425,457.07	9.15
36	600703	三安光电	11,330,081.16	9.08
37	600887	伊利股份	11,326,597.15	9.07
38	603456	九洲药业	11,231,632.00	9.00
39	600660	福耀玻璃	11,078,233.96	8.87
40	300760	迈瑞医疗	10,885,594.00	8.72
41	603186	华正新材	10,701,122.00	8.57
42	601166	兴业银行	10,643,951.00	8.53
43	002600	领益智造	10,525,112.00	8.43
44	300280	紫天科技	10,192,770.00	8.17
45	300188	美亚柏科	10,126,703.84	8.11
46	600893	航发动力	9,916,352.10	7.94
47	002156	通富微电	9,914,677.48	7.94
48	600584	长电科技	9,840,891.72	7.88
49	603711	香飘飘	9,750,014.00	7.81
50	300034	钢研高纳	9,744,965.00	7.81
51	002773	康弘药业	9,597,646.20	7.69
52	603444	吉比特	9,541,538.00	7.64
53	600867	通化东宝	9,314,368.38	7.46
54	300168	万达信息	9,299,892.76	7.45
55	300502	新易盛	9,206,155.00	7.37
56	002271	东方雨虹	8,980,271.82	7.19
57	300294	博雅生物	8,979,867.00	7.19
58	603721	中广天择	8,979,153.00	7.19
59	002511	中顺洁柔	8,699,134.00	6.97
60	600741	华域汽车	8,520,060.35	6.83

61	600029	南方航空	8,461,937.00	6.78
62	688016	心脉医疗	8,453,007.06	6.77
63	300783	三只松鼠	8,297,809.00	6.65
64	603882	金域医学	8,291,039.00	6.64
65	300655	晶瑞股份	8,195,844.46	6.57
66	688116	天奈科技	8,008,149.03	6.42
67	600521	华海药业	7,537,010.00	6.04
68	000651	格力电器	7,472,884.00	5.99
69	600449	宁夏建材	7,429,220.00	5.95
70	600763	通策医疗	7,198,095.00	5.77
71	002233	塔牌集团	7,163,805.00	5.74
72	688358	祥生医疗	6,951,833.05	5.57
73	300450	先导智能	6,903,730.14	5.53
74	000582	北部湾港	6,511,200.00	5.22
75	600699	均胜电子	6,448,705.00	5.17
76	300888	稳健医疗	6,341,666.90	5.08
77	300014	亿纬锂能	6,317,297.00	5.06
78	600436	片仔癀	6,308,474.35	5.05
79	600585	海螺水泥	6,259,223.00	5.01
80	603920	世运电路	6,187,065.00	4.96
81	002352	顺丰控股	6,166,889.23	4.94
82	000526	紫光学大	6,000,089.00	4.81
83	000009	中国宝安	5,938,958.37	4.76
84	002129	中环股份	5,892,646.83	4.72
85	601666	平煤股份	5,860,497.03	4.69
86	002049	紫光国微	5,659,504.00	4.53
87	300686	智动力	5,564,048.07	4.46
88	603337	杰克股份	5,511,695.00	4.42
89	688021	奥福环保	5,458,811.38	4.37
90	688268	华特气体	5,373,255.22	4.30
91	300326	凯利泰	5,319,699.17	4.26
92	688108	赛诺医疗	4,976,870.13	3.99
93	300420	五洋停车	4,770,270.53	3.82
94	300054	鼎龙股份	4,737,881.00	3.80
95	300724	捷佳伟创	4,565,126.00	3.66
96	300630	普利制药	4,454,703.16	3.57
97	603236	移远通信	4,386,425.80	3.51
98	300776	帝尔激光	4,288,247.20	3.44
99	002384	东山精密	4,274,593.38	3.42
100	000902	新洋丰	4,230,184.00	3.39
101	600104	上汽集团	4,211,175.00	3.37
102	603005	晶方科技	4,189,414.00	3.36

103	002405	四维图新	4,146,007.00	3.32
104	002422	科伦药业	4,056,538.00	3.25
105	300009	安科生物	4,033,848.34	3.23
106	601021	春秋航空	4,017,005.00	3.22
107	300725	药石科技	4,014,273.00	3.22
108	002241	歌尔股份	3,929,797.00	3.15
109	688019	安集科技	3,905,139.12	3.13
110	688396	华润微	3,854,883.08	3.09
111	300496	中科创达	3,843,617.00	3.08
112	688012	中微公司	3,839,649.65	3.08
113	688111	金山办公	3,768,252.25	3.02
114	002796	世嘉科技	3,734,129.00	2.99
115	688266	泽璟制药	3,713,921.20	2.98
116	000034	神州数码	3,602,958.00	2.89
117	000789	万年青	3,588,471.00	2.87
118	002916	深南电路	3,567,745.12	2.86
119	600522	中天科技	3,543,351.00	2.84
120	600720	祁连山	3,537,404.80	2.83
121	600801	华新水泥	3,502,121.18	2.81
122	300567	精测电子	3,482,967.00	2.79
123	002867	周大生	3,441,841.00	2.76
124	002572	索菲亚	3,440,710.00	2.76
125	300618	寒锐钴业	3,302,799.00	2.65
126	603799	华友钴业	3,301,780.00	2.65
127	002624	完美世界	3,288,206.20	2.63
128	688202	美迪西	3,260,975.29	2.61
129	002371	北方华创	3,193,320.36	2.56
130	000739	普洛药业	2,792,805.00	2.24
131	688981	中芯国际	2,770,961.14	2.22
132	603290	斯达半导	2,658,852.44	2.13
133	002115	三维通信	2,614,522.00	2.09

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超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	300115	长盈精密	34,758,004.03	27.84
2	300083	创世纪	24,318,647.00	19.48
3	600131	国网信通	22,905,257.59	18.35
4	300037	新宙邦	21,987,780.64	17.61
5	000401	冀东水泥	21,359,444.56	17.11

6	000538	云南白药	20,926,012.00	16.76
7	603019	中科曙光	20,840,680.60	16.70
8	603456	九洲药业	19,148,292.80	15.34
9	300347	泰格医药	19,057,110.50	15.27
10	000877	天山股份	17,688,824.02	14.17
11	300280	紫天科技	17,109,737.00	13.71
12	002212	天融信	16,759,091.69	13.43
13	601012	隆基股份	16,643,471.62	13.33
14	603986	兆易创新	16,300,397.50	13.06
15	000158	常山北明	16,268,327.76	13.03
16	300737	科顺股份	16,064,078.40	12.87
17	600459	贵研铂业	15,754,340.50	12.62
18	000725	京东方A	15,449,240.00	12.38
19	000063	中兴通讯	15,370,087.80	12.31
20	002544	杰赛科技	15,012,867.00	12.03
21	300078	思创医惠	14,126,066.99	11.32
22	300073	当升科技	13,374,375.08	10.71
23	600703	三安光电	13,190,344.00	10.57
24	600546	山煤国际	13,173,802.04	10.55
25	002824	和胜股份	12,908,130.00	10.34
26	002156	通富微电	12,728,566.06	10.20
27	002714	牧原股份	12,719,888.00	10.19
28	688358	祥生医疗	12,428,443.09	9.96
29	000651	格力电器	12,370,109.00	9.91
30	300294	博雅生物	12,185,062.00	9.76
31	603721	中广天择	11,692,146.00	9.37
32	600216	浙江医药	11,626,168.94	9.31
33	600887	伊利股份	10,696,418.51	8.57
34	600521	华海药业	10,636,039.02	8.52
35	600584	长电科技	10,512,493.03	8.42
36	600276	恒瑞医药	10,443,676.11	8.37
37	603711	香飘飘	10,296,196.00	8.25
38	300168	万达信息	10,011,007.04	8.02
39	300059	东方财富	9,949,432.27	7.97
40	300383	光环新网	9,866,613.00	7.90
41	002773	康弘药业	9,776,224.08	7.83
42	300188	美亚柏科	9,538,863.16	7.64
43	600867	通化东宝	9,528,851.88	7.63
44	300034	钢研高纳	9,393,958.65	7.53
45	002511	中顺洁柔	9,088,158.00	7.28
46	600893	航发动力	8,946,925.00	7.17
47	002241	歌尔股份	8,946,275.00	7.17

48	601666	平煤股份	8,824,145.61	7.07
49	300603	立昂技术	8,624,555.00	6.91
50	300655	晶瑞股份	8,251,510.78	6.61
51	600449	宁夏建材	8,250,301.00	6.61
52	603186	华正新材	8,096,667.60	6.49
53	600029	南方航空	7,995,133.00	6.40
54	002233	塔牌集团	7,700,115.00	6.17
55	300010	豆神教育	7,541,426.08	6.04
56	300724	捷佳伟创	7,519,597.00	6.02
57	688981	中芯国际	7,457,541.23	5.97
58	600436	片仔癀	7,340,220.03	5.88
59	300450	先导智能	7,245,356.73	5.80
60	300502	新易盛	7,081,267.00	5.67
61	688016	心脉医疗	6,932,919.03	5.55
62	603005	晶方科技	6,503,956.38	5.21
63	300783	三只松鼠	6,423,574.00	5.15
64	002129	中环股份	6,351,139.52	5.09
65	002271	东方雨虹	6,312,005.00	5.06
66	300686	智动力	6,102,220.35	4.89
67	300420	五洋停车	6,013,097.06	4.82
68	600585	海螺水泥	5,852,049.00	4.69
69	600699	均胜电子	5,656,367.00	4.53
70	603337	杰克股份	5,638,856.00	4.52
71	300776	帝尔激光	5,625,930.40	4.51
72	688108	赛诺医疗	5,616,346.89	4.50
73	002371	北方华创	5,601,188.64	4.49
74	688111	金山办公	5,598,139.91	4.48
75	688268	华特气体	5,401,699.81	4.33
76	600745	闻泰科技	5,132,082.00	4.11
77	000526	紫光学大	5,076,938.00	4.07
78	000582	北部湾港	4,968,224.10	3.98
79	300122	智飞生物	4,907,000.60	3.93
80	002049	紫光国微	4,882,287.00	3.91
81	300054	鼎龙股份	4,879,655.92	3.91
82	600519	贵州茅台	4,878,025.00	3.91
83	300326	凯利泰	4,842,984.67	3.88
84	688012	中微公司	4,407,406.43	3.53
85	000009	中国宝安	4,380,456.80	3.51
86	600763	通策医疗	4,200,100.00	3.36
87	603444	吉比特	4,169,623.00	3.34
88	300496	中科创达	4,161,847.30	3.33
89	688021	奥福环保	4,139,162.00	3.32

90	300009	安科生物	4,112,226.27	3.29
91	002368	太极股份	4,097,753.00	3.28
92	002422	科伦药业	4,096,155.52	3.28
93	601838	成都银行	4,028,517.00	3.23
94	601166	兴业银行	4,019,932.00	3.22
95	600522	中天科技	3,913,861.58	3.14
96	600720	祁连山	3,851,762.48	3.09
97	002867	周大生	3,596,781.50	2.88
98	688266	泽璟制药	3,594,776.64	2.88
99	000034	神州数码	3,529,989.00	2.83
100	002916	深南电路	3,513,335.00	2.81
101	002796	世嘉科技	3,483,805.50	2.79
102	688202	美迪西	3,451,184.65	2.76
103	002624	完美世界	3,367,577.40	2.70
104	300567	精测电子	3,296,487.00	2.64
105	600801	华新水泥	3,246,190.76	2.60
106	601138	工业富联	3,178,251.00	2.55
107	688019	安集科技	3,162,344.90	2.53
108	002572	索菲亚	3,101,375.00	2.48
109	000789	万年青	3,068,584.00	2.46
110	002384	东山精密	3,009,200.84	2.41
111	300679	电连技术	2,945,239.52	2.36
112	002439	启明星辰	2,937,597.00	2.35
113	000739	普洛药业	2,935,886.50	2.35
114	000661	长春高新	2,934,257.42	2.35
115	603233	大参林	2,928,899.00	2.35
116	688396	华润微	2,927,424.80	2.35
117	002115	三维通信	2,741,571.60	2.20
118	603799	华友钴业	2,659,485.00	2.13
119	002600	领益智造	2,640,938.00	2.12
120	300618	寒锐钴业	2,564,807.84	2.05
121	002602	世纪华通	2,564,177.00	2.05

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,251,383,238.48
卖出股票收入（成交）总额	1,160,830,755.24

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,078,249.80	0.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,078,249.80	0.27

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113038	隆 20 转债	3,560	627,592.40	0.15
2	113611	福 20 转债	3,130	450,657.40	0.11

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 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，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作为交易标的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

1、中国平安保险(集团)股份有限公司（以下简称“中国平安”，股票代码：601318）因其子公司中国平安财产保险股份有限公司于2020年8月6日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书(银保监罚决字〔2020〕58号)。其因未按车辆实际使用性质承保商业车险行为违反了《保险法》第一百三十五条的规定，被罚款50万元。手续费支出未分摊至各分支机构行为违反了《保险法》第八十六条的规定，被罚款25万元。

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中国平安进行了投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	94,251.58
2	应收证券清算款	9,003,071.48
3	应收股利	-
4	应收利息	3,264.91
5	应收申购款	1,275,385.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	10,375,973.63
---	----	---------------

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
13,019	7,716.36	1,838.07	0.00	100,457,463.44	100.00

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	90,254.96	0.09

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

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

无。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2013 年 12 月 13 日) 基金份额总额	535,770,185.52
本报告期期初基金份额总额	54,183,675.87
本报告期基金总申购份额	241,160,082.13
减：本报告期基金总赎回份额	194,884,456.49
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少 以“-”填列)	-

本报告期末基金份额总额	100,459,301.51
-------------	----------------

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 2020 年 1 月 22 日发布公告，因丁益董事长退休，由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。本基金管理人于 2020 年 9 月 12 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任李进先生担任本公司董事长。本基金管理人于 2020 年 10 月 16 日发布公告，经深圳市市场监督管理局核准，景顺长城基金管理有限公司法定代表人变更为李进先生。

2、本基金管理人于 2020 年 3 月 6 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任李黎女士担任本公司副总经理。

3、本基金管理人于 2020 年 5 月 28 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意吴建军先生辞去本公司首席信息官一职，聘任张明先生担任本公司首席信息官。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

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信息披露管理办法》《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及本基金基金合同、更新招募说明书等规定，经与基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司对本基金参与存托凭证投资修订基金合同等法律文件，包括明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证的投资

策略、投资比例限制、估值方法等，并在基金合同、基金招募说明书（更新）、产品资料概要中增加投资存托凭证的风险揭示。本次修订属于法律法规规定无需召开基金份额持有人大会的事项，修订自 2020 年 11 月 4 日起正式生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 11 月 4 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同等法律文件的公告》。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 7 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 60,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人分管副总经理由于信息技术业务人员未对系统测试结果进行审查，致使公司旗下个别基金出现拉抬股价的异常交易情形，收到深圳证监局监管谈话的决定。本报告期内，本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
西藏东方财富证券股份有限公司	2	329,553,006.77	13.81%	306,911.39	13.81%	本期新增
中国国际金融股份有限公司	2	294,664,772.33	12.34%	274,420.92	12.34%	-
华创证券有限责任公司	1	185,171,692.81	7.76%	172,450.45	7.76%	-
招商证券股份有限公司	1	160,444,396.78	6.72%	149,422.08	6.72%	-
中信建投证券股份有限公司	1	132,189,389.60	5.54%	123,108.97	5.54%	-
方正证券股份有限公司	2	129,621,102.81	5.43%	120,715.47	5.43%	-
天风证券股份有限公司	1	128,851,638.29	5.40%	120,000.28	5.40%	-
中信证券股份有限公司	2	125,327,479.82	5.25%	116,718.06	5.25%	-
东方证券股份有限公司	3	118,836,685.96	4.98%	110,672.95	4.98%	-
兴业证券股份有限公司	1	112,063,152.98	4.69%	104,364.13	4.69%	-
海通证券股份有限公司	1	109,836,276.04	4.60%	102,290.48	4.60%	-
国盛证券有限责任公司	1	94,900,794.09	3.98%	88,380.65	3.98%	-
申万宏源证券有限公司	1	85,087,683.59	3.56%	79,242.00	3.56%	-
恒泰证券股份有限公司	1	76,883,949.06	3.22%	71,602.17	3.22%	-
华西证券股份有限公司	1	76,167,547.25	3.19%	70,934.60	3.19%	本期新增

国金证券股份有限公司	1	74,686,060.95	3.13%	69,554.62	3.13%	-
安信证券股份有限公司	1	37,587,552.82	1.57%	35,005.45	1.57%	-
中国银河证券股份有限公司	1	35,258,104.46	1.48%	32,835.13	1.48%	-
太平洋证券股份有限公司	1	28,885,499.29	1.21%	26,901.04	1.21%	-
瑞银证券有限责任公司	1	18,499,351.46	0.77%	17,228.49	0.77%	-
瑞信方正证券有限责任公司	2	7,824,358.79	0.33%	7,286.82	0.33%	-
平安证券股份有限公司	1	7,240,275.00	0.30%	6,742.97	0.30%	-
国海证券股份有限公司	1	6,557,168.52	0.27%	6,106.68	0.27%	本期新增
国都证券股份有限公司	1	3,979,935.47	0.17%	3,706.70	0.17%	本期新增
国泰君安证券股份有限公司	1	3,842,998.58	0.16%	3,578.49	0.16%	-
北京高华证券有限责任公司	1	2,069,738.00	0.09%	1,927.55	0.09%	-
申港证券股份有限公司	1	779,368.00	0.03%	725.83	0.03%	本期新增
民生证券股份有限公司	1	223,185.20	0.01%	207.86	0.01%	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额

				比例		的比例
西藏东方财富证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	13,861.20	4.70%	111,100,000.00	38.58%	-	-
华创证券有限责任公司	32,583.42	11.05%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	71,243.60	24.16%	18,000,000.00	6.25%	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	37,873.77	12.84%	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	139,292.30	47.24%	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	26,800,000.00	9.31%	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	93,200,000.00	32.36%	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
瑞信方正证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	-	-	38,900,000.00	13.51%	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行基金申购、定期定额投资及基金组合产品申	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-06

	购费率优惠活动的公告		
2	景顺长城成长之星股票型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-21
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-21
4	景顺长城基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-22
5	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-30
6	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-31
7	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-03
8	景顺长城基金管理有限公司及全资子公司投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-06
9	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-06
10	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-19
11	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-20
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-25
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司基金转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-25
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-25
15	景顺长城基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-30
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-31

	公司申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告		
17	景顺长城基金管理有限公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-07
18	景顺长城基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-08
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加万联证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-10
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万联证券为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-10
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-20
22	景顺长城成长之星股票型证券投资基金 2019 年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-20
23	景顺长城成长之星股票型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-22
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-22
25	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统农业银行渠道暂停支付的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-29
26	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统农业银行渠道恢复支付的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-30
27	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在招商银行开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-14
28	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-15
29	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行股份有限公司定期定额投资最低金额限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-20
30	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-21
31	景顺长城成长之星股票型证券投资基金 2020 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-23
32	景顺长城成长之星股票型证券投资基金 2020 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-23

33	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员（首席信息官）变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-28
34	景顺长城成长之星股票型证券投资基金 2020 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-30
35	景顺长城成长之星股票型证券投资基金 2020 年第 2 号更新招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-30
36	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京汇成基金销售有限公司基金申购及转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-01
37	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-01
38	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-02
39	景顺长城基金管理有限公司关于直销 APP 交易系统相关服务的提示	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-07
40	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-09
41	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信证券等多家公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-20
42	景顺长城成长之星股票型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-21
43	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-21
44	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-31
45	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加渤海银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-31
46	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在国元证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-12
47	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加申万宏源西部证券有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-17
48	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加申万宏源证券有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-17
49	关于旗下部分基金新增海通证券股份	中国证监会指定报刊及	2020-08-18

	有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	网站	
50	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-24
51	景顺长城成长之星股票型证券投资基金 2020 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-24
52	景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-31
53	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金披露基金产品资料概要（更新）的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-31
54	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在中航证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-10
55	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-12
56	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-14
57	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-19
58	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-24
59	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-26
60	关于旗下部分基金新增腾安基金为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购、赎回费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-09
61	景顺长城基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-16
62	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-16
63	景顺长城基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型类型的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-21
64	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华鑫证券有限责任公司申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-23
65	景顺长城成长之星股票型证券投资基	中国证监会指定报刊及	2020-10-27

	金 2020 年第 3 季度报告	网站	
66	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-27
67	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-30
68	景顺长城基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-03
69	景顺长城基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-04
70	景顺长城成长之星股票型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-04
71	景顺长城成长之星股票型证券投资基金 2020 年第 3 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-04
72	景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-04
73	景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-04
74	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-05
75	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-13
76	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-26
77	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-03
78	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加信达证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-15
79	景顺长城基金管理有限公司关于终止盈信基金等公司办理相关业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-22
80	景顺长城基金管理有限公司关于终止北京电盈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	2020-12-24
81	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-31
82	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加苏州银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-31
83	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2021 倾	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-31

	心回馈”基金定投优惠活动的公告		
84	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-31

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 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信息披露管理办法》《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及本基金基金合同、更新招募说明书等规定，经与基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司对本基金参与存托凭证投资修订基金合同等法律文件，包括明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法等，并在基金合同、基金招募说明书（更新）、产品资料概要中增加投资存托凭证的风险揭示。本次修订属于法律法规规定无需召开基金份额持有人大会的事项，修订自 2020 年 11 月 4 日起正式生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 11 月 4 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同等法律文件的公告》。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2021 年 3 月 29 日