

# 长城创新驱动混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 7         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 8         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>9</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 9         |
| 3.2 基金净值表现                              | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13        |
| 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             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 15        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>16</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 16        |
| 6.2 利润表                                 | 17        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 18        |

|                                            |           |
|--------------------------------------------|-----------|
| 6.4 报表附注.....                              | 19        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>43</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 43        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 43        |
| 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.....     | 44        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 47        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 49        |
| 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.....    | 49        |
| 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..... | 49        |
| 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..... | 49        |
| 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.....    | 49        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 49        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 49        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 49        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>51</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 51        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 51        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....     | 51        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>52</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>53</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 53        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....      | 53        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 53        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 53        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 53        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....         | 53        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 53        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 55        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>57</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....    | 57        |

|                           |           |
|---------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... | 57        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>    | <b>58</b> |
| 12.1 备查文件目录.....          | 58        |
| 12.2 存放地点.....            | 58        |
| 12.3 查阅方式.....            | 58        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 长城创新驱动混合型证券投资基金    |
| 基金简称       | 长城创新驱动混合           |
| 基金主代码      | 009623             |
| 交易代码       | 009623             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2020 年 6 月 23 日    |
| 基金管理人      | 长城基金管理有限公司         |
| 基金托管人      | 中国银行股份有限公司         |
| 报告期末基金份额总额 | 1,024,759,936.28 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金投资符合创新驱动主题相关的上市公司，在控制风险的前提下，通过组合管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）创新驱动主题界定</p> <p>本基金所定义的创新驱动主题遵循国家创新驱动战略内涵，关注在技术研发、生产制造、销售流通、消费者服务等环节具备技术创新、产品创新、业务模式创新、服务创新、管理创新的上市公司。本基金关注企业研究与发展（R&amp;D）投入的定量指标并结合其他维度创新能力的定性判断，主要围绕新兴产业并辅以传统产业把握创新驱动投资机会。具体行业主要选择代表未来科技和产业发展新方向，促进科技成果向现实生产力加速转化的战略新兴产业；运用新技术、新业态、新模式进行升级改造、处于转型提升的传统产业。</p> <p>（2）个股选择</p> <p>定性分析方面，本基金将重点考虑公司所处行业的市场前景、公司在产业链中的地位、公司高新技术企业资质、公司未来的持续成长性、公司的盈利模式及公司的治理结构等。</p> <p>在定量分析方面，考虑过去三年累计研发经费占营业收入比例、研发人员及高学历人员占比、人力投入占</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>比、无形资产和开发支出等方面，筛选各项指标平均处于行业前 1/3 的公司进行关注。同时结合 PE、PB、PS、PEG 等相对估值指标以及自由现金流贴现等绝对估值方法来考察企业的估值水平，以判断当前股价高估或低估。</p> <p>本基金在关注估值指标的同时，还会关注营业收入增长率、盈利增长率、现金流量增长率、及净资产收益率等指标，来评估企业的投资价值。</p> <p>（3）港股通标的股票投资策略</p> <p>基于上述创新驱动主题界定，本基金同时关注互联互通机制下港股市场优质标的的投资机会：</p> <p>1）行业研究员重点覆盖的行业中，精选港股通中有代表性的创新型公司； 2）与 A 股公司相比具有差异化及估值优势的公司； 3）港股通综合指数成分股中，筛选市值权重较高、流动性较好的公司进行配置。</p> |
| 业绩比较基准 | $\text{中证创新驱动主题指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指数收益率（使用估值汇率折算）} \times 10\% + \text{中债综合财富指数收益率} \times 20\%$                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 风险收益特征 | <p>本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |

## 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      |      | 长城基金管理有限公司                      | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 车君                              | 许俊                   |
|         | 联系电话 | 0755-23982338                   | 010-66594319         |
|         | 电子邮箱 | chejun@ccfund.com.cn            | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-8868-666                    | 95566                |
| 传真      |      | 0755-23982328                   | 010-66594942         |
| 注册地址    |      | 深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层    | 北京市西城区复兴门内大街 1 号     |
| 办公地址    |      | 深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号     |
| 邮政编码    |      | 518026                          | 100818               |
| 法定代表人   |      | 王军                              | 刘连舸                  |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                   |
|---------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报             |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.ccfund.com.cn |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所     |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                     |
|--------|------------|--------------------------|
| 注册登记机构 | 长城基金管理有限公司 | 深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41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(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日 ) |
|---------------|----------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 448,759,271.83                         |
| 本期利润          | 187,429,754.68                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1180                                 |
| 本期加权平均净值利润率   | 10.71%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 6.71%                                  |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2021 年 6 月 30 日 )                |
| 期末可供分配利润      | 152,038,428.29                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1484                                 |
| 期末基金资产净值      | 1,176,798,364.57                       |
| 期末基金份额净值      | 1.1484                                 |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末( 2021 年 6 月 30 日 )                |
| 基金份额累计净值增长率   | 14.84%                                 |

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上述基金业绩指标不包括持有人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“期末可供分配利润”的计算方法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。

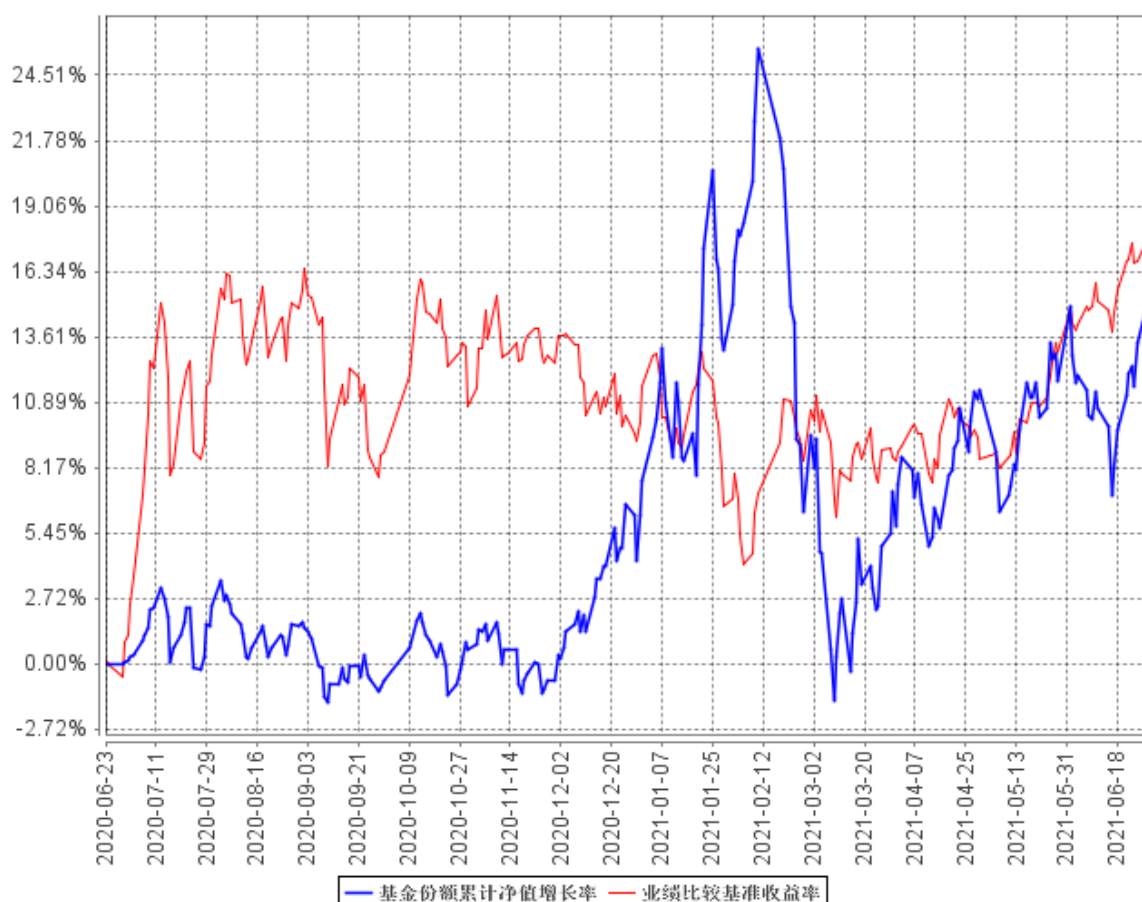
#### 3.2 基金净值表现

##### 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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去一个月          | 0.75%        | 1.13%               | 2.68%              | 0.60%                 | -1.93% | 0.53% |
| 过去三个月          | 8.66%        | 1.16%               | 8.14%              | 0.62%                 | 0.52%  | 0.54% |
| 过去六个月          | 6.71%        | 1.68%               | 5.15%              | 0.84%                 | 1.56%  | 0.84% |
| 过去一年           | 14.77%       | 1.28%               | 16.24%             | 1.04%                 | -1.47% | 0.24% |
| 过去三年           | —            | —                   | —                  | —                     | —      | —     |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 14.84%       | 1.27%               | 17.26%             | 1.04%                 | -2.42% | 0.23% |

### 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

基金份额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：①基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，投资于创新驱动主题相关股票资产比例不低于非现金基金资产的 80%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%。每个交易日日终在扣除股指期货、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、应收申购款等。

②本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 6 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 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

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司管理的基金包括：长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城稳健成长灵活配置混合型证券投资基金、长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润灵活配置混合型证券投资基金、长城久益灵活配置混合型证券投资基金、长城久源灵活配置混合型证券投资基金、长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金、长城创业板指数增强型发起式证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城收益宝货币市场基金、长城智能产业灵活配置混合型证券投资基金、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、长城久悦债券型证券投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选股票型证券投资基金、长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金、长城研究精选混合型证

券投资基金、长城短债债券型证券投资基金、长城久瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长城嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、长城量化小盘股票型证券投资基金、长城泰利纯债债券型证券投资基金、长城价值优选混合型证券投资基金、长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城创新驱动混合型证券投资基金、长城中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长城健康生活灵活配置混合型证券投资基金、长城成长先锋混合型证券投资基金、长城恒泰养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城优选增强六个月持有期混合型证券投资基金、长城中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、长城均衡优选混合型证券投资基金、长城品质成长混合型证券投资基金、长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金、长城稳利纯债债券型证券投资基金、长城价值成长六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添瑞六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选稳进六个月持有期混合型证券投资基金、长城消费 30 股票型证券投资基金、长城医药科技六个月持有期混合型证券投资基金、长城悦享回报债券型证券投资基金。

#### 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 |        |                                                                                                                                  |
| 谭小兵 | 长城医疗保健混合、长城创新驱动混合、长城健康生活混合、长城医药科技六个月混合的基金经理 | 2020 年 6 月 23 日 | -    | 13 年   | 女，中国籍，硕士。曾就职于联邦制药(成都)有限公司、东莞证券有限责任公司、信达澳银基金管理有限公司。2014 年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员、“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理助理、“长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金”的基金经理。 |

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《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

注：本报告期，无基金经理兼任投资经理情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城创新驱动混合型证券投资

基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金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% 的现象。

### 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

在全球新冠疫苗接种进展明显快于预期的背景下，市场更多地关注宏观经济增长情况以及流动性收紧的预期拐点。从二季度宏观经济数据来看，美国的经济恢复并没有想象中快，这就导致 QE 退出的时间表是要慢于预期的；而国内这边，下半年在出口增长下来之后，经济增长的速度也是低于年初预期的，因此短期就有了相对宽松的流动性，这就给成长股带来了机会，特别是长期赛道好叠加短期高景气度的领域。本基金在宏观环境变化所导致的市场风格转变下，聚焦于医药、新能源、新消费等领域。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 6.71%，业绩比较基准收益率为 5.15%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，7 月份 PMI 继续回落，按照目前专项债的发行情况，下半年大概率依然是紧信用宽货币的组合，同时消费相比上半年不会有很大起色，出口大概率还会下行，因此经济下行不可避免，所以国内货币大概率宽松。对于市场最关注的美国货币政策，按照最近美国的经济数据，大概率不会很激进，美联储有足够耐心等待经济复苏，不过美国可能已经过了最宽松的点，所以在美债收益率不断下降以后，估计继续下降空间也不大了，甚至不排除逐步回升。

总结来说，国内大概率经济继续下行，流动性持续宽松，所以受损于宏观经济下行的方向需要回避；海外流动性边际上很难更宽松，外资短期也不会继续加仓中国资产，所以对于景气行业尽量不要过度期待估值扩张。本基金会上去选择明年景气能持续、业绩能有比较高增长，并且估值没明显扩张的品种。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部总经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理作为估值委员会成员，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，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署债券估值数据服务协议、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

## § 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长城创新驱动混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：长城创新驱动混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 229,759,056.29                 | 742,293,885.74                   |
| 结算备付金           |            | 2,550,904.01                   | 29,552,908.71                    |
| 存出保证金           |            | 1,093,958.25                   | 1,320,493.06                     |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 954,273,562.63                 | 3,354,224,285.15                 |
| 其中：股票投资         |            | 954,273,562.63                 | 3,047,483,609.87                 |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | -                              | 306,740,675.28                   |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 36,733,914.88                  | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 27,253.02                      | 2,097,902.32                     |
| 应收股利            |            | 134,835.58                     | -                                |
| 应收申购款           |            | 177,266.10                     | 497,351.84                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 1,224,750,750.76               | 4,129,986,826.82                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 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       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | 19,705,118.61                    |
| 应付赎回款           |            | 43,523,387.66                  | 283,278,578.44                   |
| 应付管理人报酬         |            | 1,530,038.51                   | 5,696,618.46                     |
| 应付托管费           |            | 255,006.40                     | 949,436.43                       |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 2,526,892.44                   | 3,498,279.88                     |
| 应交税费            |            | -                              | 39.93                            |



|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利息          |          | -                | -                |
| 应付利润          |          | -                | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 117,061.18       | 612,365.77       |
| 负债合计          |          | 47,952,386.19    | 313,740,437.52   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 1,024,759,936.28 | 3,546,138,266.41 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 152,038,428.29   | 270,108,122.89   |
| 所有者权益合计       |          | 1,176,798,364.57 | 3,816,246,389.30 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 1,224,750,750.76 | 4,129,986,826.82 |

注：(1). 报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1484 元，基金份额总额 1,024,759,936.28 份。

(2). 本基金基金合同于 2020 年 06 月 23 日生效。

## 6.2 利润表

会计主体：长城创新驱动混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 6 月 23 日(基<br>金合同生效日)至<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 216,240,321.48                           | 5,916,144.77                                                |
| 1.利息收入                |            | 787,600.28                               | 2,161,871.32                                                |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 666,252.44                               | 1,054,697.27                                                |
| 债券利息收入                |            | 121,347.84                               | -                                                           |
| 资产支持证券利息收入            |            | -                                        | -                                                           |
| 买入返售金融资产收入            |            | -                                        | 1,107,174.05                                                |
| 证券出借利息收入              |            | -                                        | -                                                           |
| 其他利息收入                |            | -                                        | -                                                           |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 474,753,466.13                           | -                                                           |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 469,302,319.31                           | -                                                           |
| 基金投资收益                |            | -                                        | -                                                           |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 1,798,621.66                             | -                                                           |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.2 | -                                        | -                                                           |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -                                        | -                                                           |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -                                        | -                                                           |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 3,652,525.16                             | -                                                           |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -261,329,517.15                          | 3,754,273.45                                                |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                        | -                                                           |

|                            |            |                |              |
|----------------------------|------------|----------------|--------------|
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.18   | 2,028,772.22   | -            |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 28,810,566.80  | 2,169,184.18 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 13,202,854.88  | 1,693,060.67 |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 2,200,475.76   | 282,176.79   |
| 3. 销售服务费                   |            | -              | -            |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 13,256,472.81  | 190,413.36   |
| 5. 利息支出                    |            | -              | -            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -              | -            |
| 6. 税金及附加                   |            | 2.08           | -            |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 150,761.27     | 3,533.36     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 187,429,754.68 | 3,746,960.59 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 187,429,754.68 | 3,746,960.59 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城创新驱动混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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）                        | 3,546,138,266.41                      | 270,108,122.89  | 3,816,246,389.30  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 187,429,754.68  | 187,429,754.68    |
| 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）      | -2,521,378,330.13                     | -305,499,449.28 | -2,826,877,779.41 |
| 其中：1.基金申购款                             | 97,988,173.85                         | 10,966,557.17   | 108,954,731.02    |
| 2. 基金赎回款                               | -2,619,366,503.98                     | -316,466,006.45 | -2,935,832,510.43 |
| 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)                        | 1,024,759,936.28                                     | 152,038,428.29 | 1,176,798,364.57 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 6 月 23 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 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)                        | 5,901,353,494.87                                     | -              | 5,901,353,494.87 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                                    | 3,746,960.59   | 3,746,960.59     |
| 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)      | -                                                    | -              | -                |
| 其中：1.基金申购款                             | -                                                    | -              | -                |
| 2.基金赎回款                                | -                                                    | -              | -                |
| 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)                        | 5,901,353,494.87                                     | 3,746,960.59   | 5,905,100,455.46 |

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：

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| <u>王军</u> | <u>邱春杨</u> | <u>赵永强</u> |
| 基金管理人负责人  | 主管会计工作负责人  | 会计机构负责人    |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长城创新驱动混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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【2020】884 号文“关于准予长城创新驱动混合型证券投资基金注册的批复”的核准,由长城基金管理有限公司自 2020 年 6 月 4 日至 2020 年 6 月 18 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2020)验字第 60737541\_H07 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 6 月 23 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的有效认购资金(本金)为人民币

5,900,410,147.84 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 943,347.03 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 5,901,353,494.87 元，折合 5,901,353,494.87 份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

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（含中小板、创业板、存托凭证及其他依法发行、上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、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相关规定）。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，投资于创新驱动主题相关股票资产比例不低于非现金基金资产的 80%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%。每个交易日日终在扣除股指期货、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、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证创新驱动主题指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债综合财富指数收益率×20%。

#### 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、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2021 年 06 月 30 日的财

务状况以及自 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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。

#### 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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 2. 增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

### 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》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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 号文《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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

#### 4. 境外投资

本基金运作过程中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 号文《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 号文《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 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 229,759,056.29         |
| 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 个月以上    | —                      |
| 其他存款           | —                      |
| 合计：            | 229,759,056.29         |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                |                |
|---------------|------------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 819,487,573.12         | 954,273,562.63 | 134,785,989.51 |
| 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 | 819,487,573.12 | 954,273,562.63 | 134,785,989.51 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末未持有衍生金融资产/负债。

### 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

注：本基金于本期末各项买入返售金融资产余额均为零。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 23,509.32              |
| 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  | 3,208.66               |
| 应收债券利息     | -                      |
| 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         | 535.04                 |
| 合计         | 27,253.02              |

注：其他为应收交易所结算保证金利息和应收深港通风控保证金利息。

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|



|             | 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 2,526,892.44    |
| 银行间市场应付交易费用 | -               |
| 合计          | 2,526,892.44    |

注：应付交易所市场交易费用均为应付佣金。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 8,882.23               |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 108,178.95             |
| 预提审计费       | -                      |
| 合计          | 117,061.18             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                   |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额              |
| 上年度末          | 3,546,138,266.41                      | 3,546,138,266.41  |
| 本期申购          | 97,988,173.85                         | 97,988,173.85     |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -2,619,366,503.98                     | -2,619,366,503.98 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                     | -                 |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                     | -                 |
| 本期申购          | -                                     | -                 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                                     | -                 |
| 本期末           | 1,024,759,936.28                      | 1,024,759,936.28  |

注：本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

#### 6.4.7.10 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           | -49,790,870.47  | 319,898,993.36  | 270,108,122.89  |
| 本期利润           | 448,759,271.83  | -261,329,517.15 | 187,429,754.68  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -153,613,480.72 | -151,885,968.56 | -305,499,449.28 |

|          |                 |                 |                 |
|----------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 其中：基金申购款 | 11,787,675.02   | -821,117.85     | 10,966,557.17   |
| 基金赎回款    | -165,401,155.74 | -151,064,850.71 | -316,466,006.45 |
| 本期已分配利润  | -               | -               | -               |
| 本期末      | 245,354,920.64  | -93,316,492.35  | 152,038,428.29  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 562,404.17                            |
| 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 | 91,395.81                             |
| 其他        | 12,452.46                             |
| 合计        | 666,252.44                            |

注：其他为结算保证金利息收入及深港通风控保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 5,021,588,787.53                      |
| 减：卖出股票成本总额 | 4,552,286,468.22                      |
| 买卖股票差价收入   | 469,302,319.31                        |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 309,633,479.14             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 305,742,000.00             |
| 减：应收利息总额                | 2,092,857.48               |
| 买卖债券差价收入                | 1,798,621.66               |

#### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益/损失。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益/损失。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益/损失。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 3,652,525.16                          |
| 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            | 3,652,525.16                          |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | -261,329,517.15                       |
| ——股票投资                     | -260,330,841.87                       |
| ——债券投资                     | -998,675.28                           |
| ——资产支持证券投资                 | -                                     |
| ——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<br>增值税 | -                                     |
| 合计                         | -261,329,517.15                       |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|          | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------|
| 基金赎回费收入  | 2,026,724.47                    |
| 转出基金补偿收入 | 2,047.75                        |
| 合计       | 2,028,772.22                    |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 13,255,272.81                         |
| 银行间市场交易费用 | 1,200.00                              |
| 交易基金产生的费用 | -                                     |
| 其中：申购费    | -                                     |
| 赎回费       | -                                     |
| 合计        | 13,256,472.81                         |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 审计费用       | 39,671.58                             |
| 信息披露费      | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金    | -                                     |
| 银行间债券账户服务费 | 13,500.00                             |
| 银行费用       | 23,582.32                             |
| 上清所结算账户服务费 | 13,500.00                             |
| 其他         | 1,000.00                              |
| 合计         | 150,761.27                            |

注：其他为证券账户开户费 400.00 元及上海清算所查询服务费 600.00 元。

#### 6.4.7.21 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。

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期无与对本基金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。

##### 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             |
|--------------------|---------------------|
| 长城基金管理有限公司         | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行               | 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”） | 基金管理人股东、基金销售机构      |

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                      | 上年度可比期间<br>2020年6月23日(基金合同生效日)至<br>2020年6月30日 |                      |
|-------|----------------------------|----------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 | 成交金额                                          | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 长城证券  | 1,713,218,599.28           | 22.15%               | -                                             | -                    |

### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2020年6月23日(基金合同生效日)至<br>2020年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|-----------------------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额                                          | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 长城证券  | 7,695,883.73               | 100.00%          | -                                             | -                |

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日                |                |            |                  |
|-------|-------------------------------------------|----------------|------------|------------------|
|       | 当期佣金                                      | 占当期佣金总量<br>的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 长城证券  | 1,495,612.02                              | 21.05%         | 429,400.88 | 16.99%           |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020年6月23日(基金合同生效日)至2020年6月30日 |                |            |                  |
|       | 当期佣金                                      | 占当期佣金总量<br>的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 长城证券  | -                                         | -              | -          | -                |

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和证券交易所买(卖)证管费等)。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月 | 上年度可比期间<br>2020年6月23日(基金合同生效日) |
|----|-------------------------|--------------------------------|
|----|-------------------------|--------------------------------|

|                 | 30 日          | 至2020年6月30日  |
|-----------------|---------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 13,202,854.88 | 1,693,060.67 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 5,642,985.13  | 976,676.70   |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 | 上年度可比期间<br>2020年6月23日(基金合同生效日)至2020年6月30日 |
|----------------|----------------------------|-------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,200,475.76               | 282,176.79                                |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 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

注：本基金本期及上年度可比期间均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

注：本基金本期无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。

##### 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

注：本基金本期无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。

#### 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

注：本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间未运用固有资金投资于本基金份额，于本期末及上年度可比期末亦未持有本基金份额。

##### 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

注：除基金管理人之外的本基金其他关联方于本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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |            | 上年度可比期间<br>2020 年 6 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2020 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       |
| 中国银行  | 229,759,056.29                        | 562,404.17 | 374,213,410.48                                         | 1,054,697.27 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间未有在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021 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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 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<br>(单位：股) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 688425               | 铁建重工 | 2021 年 6 月 11 日 | 2021 年 12 月 22 日 | 新股锁定   | 2.87  | 4.75   | 135,282      | 388,259.34 | 642,589.50 | -  |
| 688630               | 芯碁微装 | 2021 年 3 月 25 日 | 2021 年 10 月 8 日  | 新股锁定   | 15.23 | 58.42  | 3,397        | 51,736.31  | 198,452.74 | -  |
| 301006               | 迈拓股份 | 2021 年 5 月 31 日 | 2021 年 12 月 7 日  | 新股锁定   | 14.42 | 24.89  | 5,051        | 72,835.42  | 125,719.39 | -  |



|        |      |                 |                  |       |       |        |       |           |           |   |
|--------|------|-----------------|------------------|-------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 688639 | 华恒生物 | 2021 年 4 月 14 日 | 2021 年 10 月 22 日 | 新股锁定  | 23.16 | 42.28  | 2,302 | 53,314.32 | 97,328.56 | - |
| 688201 | 信安世纪 | 2021 年 4 月 13 日 | 2021 年 10 月 21 日 | 新股锁定  | 26.78 | 45.41  | 2,129 | 57,014.62 | 96,677.89 | - |
| 688499 | 利元亨  | 2021 年 6 月 23 日 | 2021 年 7 月 1 日   | 新股未上市 | 38.85 | 38.85  | 2,149 | 83,488.65 | 83,488.65 | - |
| 301018 | 申菱环境 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 7 日   | 新股未上市 | 8.29  | 8.29   | 7,811 | 64,753.19 | 64,753.19 | - |
| 688087 | 英科再生 | 2021 年 6 月 30 日 | 2021 年 7 月 9 日   | 新股未上市 | 21.96 | 21.96  | 2,469 | 54,219.24 | 54,219.24 | - |
| 688260 | 昀冢科技 | 2021 年 3 月 25 日 | 2021 年 10 月 8 日  | 新股锁定  | 9.63  | 16.41  | 2,990 | 28,793.70 | 49,065.90 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 6 日   | 新股未上市 | 10.64 | 10.64  | 4,210 | 44,794.40 | 44,794.40 | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021 年 6 月 23 日 | 2021 年 7 月 5 日   | 新股未上市 | 8.86  | 8.86   | 4,995 | 44,255.70 | 44,255.70 | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021 年 4 月 8 日  | 2021 年 10 月 15 日 | 新股锁定  | 28.28 | 115.71 | 360   | 10,180.80 | 41,655.60 | - |
| 688367 | 工大高科 | 2021 年 6 月 21 日 | 2021 年 12 月 28 日 | 新股锁定  | 11.53 | 17.94  | 1,717 | 19,797.01 | 30,802.98 | - |
| 300941 | 创识科技 | 2021 年 2 月 2 日  | 2021 年 8 月 9 日   | 新股锁定  | 21.31 | 49.94  | 399   | 8,502.69  | 19,926.06 | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021 年 6 月 22 日 | 2021 年 12 月 30 日 | 新股锁定  | 7.64  | 38.83  | 462   | 3,529.68  | 17,939.46 | - |
| 688226 | 威腾电气 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月       | 新股未上市 | 6.42  | 6.42   | 2,693 | 17,289.06 | 17,289.06 | - |

|        |           |                       |                           |           |       |       |       |           |           |   |
|--------|-----------|-----------------------|---------------------------|-----------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
|        |           | 日                     | 7 日                       |           |       |       |       |           |           |   |
| 300982 | 苏文<br>电能  | 2021 年<br>4 月 19<br>日 | 2021<br>年 10<br>月 27<br>日 | 新股锁<br>定  | 15.83 | 45.29 | 317   | 5,018.11  | 14,356.93 | - |
| 300968 | 格林<br>精密  | 2021 年<br>4 月 6 日     | 2021<br>年 10<br>月 15<br>日 | 新股锁<br>定  | 6.87  | 12.07 | 1,162 | 7,982.94  | 14,025.34 | - |
| 300614 | 百川<br>畅银  | 2021 年<br>5 月 18<br>日 | 2021<br>年 11<br>月 25<br>日 | 新股锁<br>定  | 9.19  | 40.38 | 329   | 3,023.51  | 13,285.02 | - |
| 301013 | C 利<br>和兴 | 2021 年<br>6 月 21<br>日 | 2021<br>年 12<br>月 29<br>日 | 新股锁<br>定  | 8.72  | 27.11 | 471   | 4,107.12  | 12,768.81 | - |
| 301002 | 崧盛<br>股份  | 2021 年<br>5 月 27<br>日 | 2021<br>年 12<br>月 7 日     | 新股锁<br>定  | 18.71 | 57.62 | 201   | 3,760.71  | 11,581.62 | - |
| 605287 | 德才<br>股份  | 2021 年<br>6 月 28<br>日 | 2021<br>年 7 月<br>6 日      | 新股未<br>上市 | 31.56 | 31.56 | 349   | 11,014.44 | 11,014.44 | - |
| 300996 | 普联<br>软件  | 2021 年<br>5 月 26<br>日 | 2021<br>年 12<br>月 3 日     | 新股锁<br>定  | 20.81 | 42.23 | 241   | 5,015.21  | 10,177.43 | - |
| 300956 | 英力<br>股份  | 2021 年<br>3 月 16<br>日 | 2021<br>年 9 月<br>27 日     | 新股锁<br>定  | 12.85 | 25.80 | 371   | 4,767.35  | 9,571.80  | - |
| 300962 | 中金<br>辐照  | 2021 年<br>3 月 29<br>日 | 2021<br>年 10<br>月 11<br>日 | 新股锁<br>定  | 3.40  | 16.37 | 576   | 1,958.40  | 9,429.12  | - |
| 300961 | 深水<br>海纳  | 2021 年<br>3 月 23<br>日 | 2021<br>年 9 月<br>30 日     | 新股锁<br>定  | 8.48  | 22.07 | 394   | 3,341.12  | 8,695.58  | - |
| 300950 | 德固<br>特   | 2021 年<br>2 月 24<br>日 | 2021<br>年 9 月<br>3 日      | 新股锁<br>定  | 8.41  | 39.13 | 219   | 1,841.79  | 8,569.47  | - |
| 605162 | 新中<br>港   | 2021 年<br>6 月 29<br>日 | 2021<br>年 7 月<br>7 日      | 新股未<br>上市 | 6.07  | 6.07  | 1,377 | 8,358.39  | 8,358.39  | - |
| 300986 | 志特        | 2021 年                | 2021                      | 新股锁       | 14.79 | 30.57 | 264   | 3,904.56  | 8,070.48  | - |

|        |      |            |             |      |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|-------------|------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
|        | 新材   | 4月21日      | 年11月1日      | 定    |       |       |     |          |          |   |
| 300978 | 东箭科技 | 2021年4月15日 | 2021年10月26日 | 新股锁定 | 8.42  | 13.60 | 593 | 4,993.06 | 8,064.80 | - |
| 300993 | 玉马遮阳 | 2021年5月17日 | 2021年11月24日 | 新股锁定 | 12.10 | 19.29 | 410 | 4,961.00 | 7,908.90 | - |
| 301004 | C嘉益  | 2021年6月18日 | 2021年12月27日 | 新股锁定 | 7.81  | 21.94 | 312 | 2,436.72 | 6,845.28 | - |
| 300991 | 创益通  | 2021年5月12日 | 2021年11月22日 | 新股锁定 | 13.06 | 26.51 | 254 | 3,317.24 | 6,733.54 | - |
| 301011 | 华立科技 | 2021年6月9日  | 2021年12月17日 | 新股锁定 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00 | 5,922.00 | - |
| 300943 | 春晖智控 | 2021年2月3日  | 2021年8月10日  | 新股锁定 | 9.79  | 23.01 | 255 | 2,496.45 | 5,867.55 | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021年3月22日 | 2021年9月29日  | 新股锁定 | 12.08 | 23.06 | 234 | 2,826.72 | 5,396.04 | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021年6月23日 | 2022年1月5日   | 新股锁定 | 8.86  | 8.86  | 555 | 4,917.30 | 4,917.30 | - |
| 300995 | 奇德新材 | 2021年5月17日 | 2021年11月26日 | 新股锁定 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52 | 4,454.12 | - |
| 301007 | 德迈仕  | 2021年6月4日  | 2021年12月16日 | 新股锁定 | 5.29  | 14.44 | 303 | 1,602.87 | 4,375.32 | - |
| 300992 | 泰福泵业 | 2021年5月17日 | 2021年11月25日 | 新股锁定 | 9.36  | 20.32 | 200 | 1,872.00 | 4,064.00 | - |

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有因暂时停牌等流通受限的股票。

#### 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

截止本报告期末，本基金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为 0.00 元，无质押证券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金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为 0.00 元，无质押证券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金于本期末未持有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。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、投资决策委员会、监察稽核部和风险管理部，以及相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

##### 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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金投资于具有良好信用等级的证券，且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股票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，不得超过该证券市值的 10%。

本基金在交易所进行的交易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；基金在进行银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

### 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基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另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。

#### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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资产的公允价值。

除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的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。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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公允价值，并按照合约

规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 年 6 月 30 日   | 1 个月以内         | 1-3<br>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                     | 229,759,056.29 | -         | -              | -     | -            | -                | 229,759,056.29   |
| 结算备付金                    | 2,550,904.01   | -         | -              | -     | -            | -                | 2,550,904.01     |
| 存出保证金                    | 1,093,958.25   | -         | -              | -     | -            | -                | 1,093,958.25     |
| 交易性金融资产                  | -              | -         | -              | -     | -            | 954,273,562.63   | 954,273,562.63   |
| 应收证券清算款                  | -              | -         | -              | -     | -            | 36,733,914.88    | 36,733,914.88    |
| 应收利息                     | -              | -         | -              | -     | -            | 27,253.02        | 27,253.02        |
| 应收股利                     | -              | -         | -              | -     | -            | 134,835.58       | 134,835.58       |
| 应收申购款                    | -              | -         | -              | -     | -            | 177,266.10       | 177,266.10       |
| 资产总计                     | 233,403,918.55 | -         | -              | -     | -            | 991,346,832.21   | 1,224,750,750.76 |
| 负债                       |                |           |                |       |              |                  |                  |
| 应付赎回款                    | -              | -         | -              | -     | -            | 43,523,387.66    | 43,523,387.66    |
| 应付管理人报酬                  | -              | -         | -              | -     | -            | 1,530,038.51     | 1,530,038.51     |
| 应付托管费                    | -              | -         | -              | -     | -            | 255,006.40       | 255,006.40       |
| 应付交易费用                   | -              | -         | -              | -     | -            | 2,526,892.44     | 2,526,892.44     |
| 其他负债                     | -              | -         | -              | -     | -            | 117,061.18       | 117,061.18       |
| 负债总计                     | -              | -         | -              | -     | -            | 47,952,386.19    | 47,952,386.19    |
| 利率敏感度缺口                  | 233,403,918.55 | -         | -              | -     | -            | -                | -                |
| 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 | 1 个月以内         | 1-3<br>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                     | 742,293,885.74 | -         | -              | -     | -            | -                | 742,293,885.74   |
| 结算备付金                    | 29,552,908.71  | -         | -              | -     | -            | -                | 29,552,908.71    |
| 存出保证金                    | 1,320,493.06   | -         | -              | -     | -            | -                | 1,320,493.06     |
| 交易性金融资产                  | -              | -         | 299,755,000.00 | -     | 6,985,675.28 | 3,047,483,609.87 | 3,354,224,285.15 |
| 应收利息                     | -              | -         | -              | -     | -            | 2,097,902.32     | 2,097,902.32     |
| 应收申购款                    | -              | -         | -              | -     | -            | 497,351.84       | 497,351.84       |
| 资产总计                     | 773,167,287.51 | -         | 299,755,000.00 | -     | 6,985,675.28 | 3,050,078,864.03 | 4,129,986,826.82 |
| 负债                       |                |           |                |       |              |                  |                  |
| 应付证券清算款                  | -              | -         | -              | -     | -            | 19,705,118.61    | 19,705,118.61    |
| 应付赎回款                    | -              | -         | -              | -     | -            | 283,278,578.44   | 283,278,578.44   |
| 应付管理人报酬                  | -              | -         | -              | -     | -            | 5,696,618.46     | 5,696,618.46     |
| 应付托管费                    | -              | -         | -              | -     | -            | 949,436.43       | 949,436.43       |
| 应付交易费用                   | -              | -         | -              | -     | -            | 3,498,279.88     | 3,498,279.88     |
| 应交税费                     | -              | -         | -              | -     | -            | 39.93            | 39.93            |

|         |                |                 |               |   |                |                |
|---------|----------------|-----------------|---------------|---|----------------|----------------|
| 其他负债    | -              | -               | -             | - | 612,365.77     | 612,365.77     |
| 负债总计    | -              | -               | -             | - | 313,740,437.52 | 313,740,437.52 |
| 利率敏感度缺口 | 773,167,287.51 | -299,755,000.00 | -6,985,675.28 |   |                |                |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时 |                                 |                        |
|----|---------------------------|---------------------------------|------------------------|
| 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                           | 本期末（2021 年 6 月 30 日）            | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|    | 利率上升 25 个基点               | 0.00                            | -499,592.18            |
|    | 利率下降 25 个基点               | 0.00                            | 501,302.64             |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

于本期末及上年度末，本基金面临的外汇风险敞口及外汇风险敏感性分析列示如下：

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                |                   |                |
|--------------|------------------------|----------------|-------------------|----------------|
|              | 美元<br>折合人民<br>币        | 港币<br>折合人民币    | 其他币种<br>折合人民<br>币 | 合计             |
| 以外币计价的资产     |                        |                |                   |                |
| 交易性金融资产      | -                      | 149,580,256.67 | -                 | 149,580,256.67 |
| 资产合计         | -                      | 149,580,256.67 | -                 | 149,580,256.67 |
| 以外币计价的负债     |                        |                |                   |                |
| 负债合计         | -                      | -              | -                 | -              |
| 资产负债表外汇风险敞口净 | -                      | 149,580,256.67 | -                 | 149,580,256.67 |

| 额             |                  |               |               |               |
|---------------|------------------|---------------|---------------|---------------|
| 项目            | 上年度末             |               |               |               |
|               | 2020 年 12 月 31 日 |               |               |               |
|               | 美元<br>折合人民币      | 港币<br>折合人民币   | 其他币种<br>折合人民币 | 合计            |
| 以外币计价的资产      |                  |               |               |               |
| 交易性金融资产       | -                | 94,889,523.50 | -             | 94,889,523.50 |
| 资产合计          | -                | 94,889,523.50 | -             | 94,889,523.50 |
| 以外币计价的负债      |                  |               |               |               |
| 负债合计          | -                | -             | -             | -             |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                | 94,889,523.50 | -             | 94,889,523.50 |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率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<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                  | 本期末（2021 年 6 月 30 日）            | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|    | 所有外币均相对人民币升值 5%  | 7,479,012.83                    | 4,744,476.18           |
|    | 所有外币均相对人民币贬值 5%  | -7,479,012.83                   | -4,744,476.18          |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素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股票和债券，所面临的最大其他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他价格风险，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。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，投资于创新驱动主题相关股票资产比例不低于非现金基金资产的 80%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%。每个交易日日终在扣除股指期货、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、应收申购款等。

于本报告期末及上年度末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 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<br>2021 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                       |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 954,273,562.63         | 81.09                    | 3,047,483,609.87         | 79.86                 |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | —                        | —                        | —                     |
| 交易性金融资产—债券投资  | —                      | —                        | 306,740,675.28           | 8.04                  |
| 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            | 954,273,562.63         | 81.09                    | 3,354,224,285.15         | 87.90                 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时 |                                 |                           |
|----|-------------------------------|---------------------------------|---------------------------|
| 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                           |
|    |                               | 本期末（2021 年 6 月<br>30 日）         | 上年度末（2020 年 12 月<br>31 日） |
|    | 沪深 300 指数上升 5%                | 63,883,843.65                   | 150,119,042.62            |
|    | 沪深 300 指数下降 5%                | -63,883,843.65                  | -150,119,042.62           |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 6.4.14.2 其他事项

##### (1) 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、存出保证金、其他应收款项类投资以及其他金融负债，因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 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划分为第一层次的余额为人民币 952,440,151.03 元，划分为第二层次的余额为人民币 1,833,411.60 元，无划分为第三层次的余额。

##### 公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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。

##### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(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。

## § 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              | 954,273,562.63   | 77.92         |
|    | 其中：股票             | 954,273,562.63   | 77.92         |
| 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      | 232,309,960.30   | 18.97         |
| 8  | 其他各项资产            | 38,167,227.83    | 3.12          |
| 9  | 合计                | 1,224,750,750.76 | 100.00        |

### 7.2 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         | —              | —             |
| B  | 采矿业              | —              | —             |
| C  | 制造业              | 587,373,850.51 | 49.91         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,020.39      | 0.00          |
| E  | 建筑业              | 25,371.37      | 0.00          |
| F  | 批发和零售业           | 21,241,517.97  | 1.81          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —              | —             |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 21,769,894.78  | 1.85          |
| J  | 金融业              | 19,289,009.10  | 1.64          |
| K  | 房地产业             | 10,095.90      | 0.00          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 35,150,184.30  | 2.99          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 95,005,209.00  | 8.07          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 21,980.60      | 0.00          |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —              | —             |

|   |           |                |       |
|---|-----------|----------------|-------|
| P | 教育        | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作   | 24,793,172.04  | 2.11  |
| R | 文化、体育和娱乐业 | -              | -     |
| S | 综合        | -              | -     |
|   | 合计        | 804,693,305.96 | 68.38 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别      | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|-----------|----------------|--------------|
| A 基础材料    | -              | -            |
| B 消费者非必需品 | -              | -            |
| C 消费者常用品  | -              | -            |
| D 能源      | -              | -            |
| E 金融      | -              | -            |
| F 医疗保健    | 70,895,791.36  | 6.02         |
| G 工业      | -              | -            |
| H 信息技术    | 36,044,665.50  | 3.06         |
| I 电信服务    | 42,639,799.81  | 3.62         |
| J 公用事业    | -              | -            |
| K 房地产     | -              | -            |
| 合计        | 149,580,256.67 | 12.71        |

### 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          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 603259 | 药明康德 | 365,160   | 57,180,404.40 | 4.86         |
| 2  | 603456 | 九洲药业 | 1,153,384 | 56,031,394.72 | 4.76         |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 25,800    | 53,062,860.00 | 4.51         |
| 4  | 03347  | 泰格医药 | 287,100   | 43,478,010.58 | 3.69         |
| 5  | 00700  | 腾讯控股 | 87,748    | 42,639,799.81 | 3.62         |
| 6  | 300601 | 康泰生物 | 260,410   | 38,801,090.00 | 3.30         |
| 7  | 000858 | 五粮液  | 128,200   | 38,189,498.00 | 3.25         |
| 8  | 688202 | 美迪西  | 72,754    | 37,824,804.60 | 3.21         |
| 9  | 601012 | 隆基股份 | 407,865   | 36,234,726.60 | 3.08         |
| 10 | 00981  | 中芯国际 | 1,812,500 | 36,044,665.50 | 3.06         |
| 11 | 300280 | 紫天科技 | 961,400   | 35,100,714.00 | 2.98         |
| 12 | 300750 | 宁德时代 | 58,100    | 31,071,880.00 | 2.64         |
| 13 | 01521  | 方达控股 | 3,994,000 | 27,417,452.04 | 2.33         |
| 14 | 300015 | 爱尔眼科 | 349,298   | 24,793,172.04 | 2.11         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 15 | 600399 | 抚顺特钢 | 1,266,100 | 22,967,054.00 | 1.95 |
| 16 | 300059 | 东方财富 | 587,200   | 19,254,288.00 | 1.64 |
| 17 | 300760 | 迈瑞医疗 | 39,668    | 19,042,623.40 | 1.62 |
| 18 | 000596 | 古井贡酒 | 79,400    | 19,016,300.00 | 1.62 |
| 19 | 688208 | 道通科技 | 212,093   | 18,449,970.07 | 1.57 |
| 20 | 002230 | 科大讯飞 | 264,800   | 17,895,184.00 | 1.52 |
| 21 | 002706 | 良信股份 | 792,500   | 17,862,950.00 | 1.52 |
| 22 | 002459 | 晶澳科技 | 327,370   | 16,041,130.00 | 1.36 |
| 23 | 603806 | 福斯特  | 130,340   | 13,702,644.20 | 1.16 |
| 24 | 600584 | 长电科技 | 347,400   | 13,090,032.00 | 1.11 |
| 25 | 300957 | 贝泰妮  | 42,000    | 11,410,980.00 | 0.97 |
| 26 | 600132 | 重庆啤酒 | 57,200    | 11,322,740.00 | 0.96 |
| 27 | 601865 | 福莱特  | 284,600   | 11,250,238.00 | 0.96 |
| 28 | 000963 | 华东医药 | 240,100   | 11,047,001.00 | 0.94 |
| 29 | 688599 | 天合光能 | 375,160   | 10,635,786.00 | 0.90 |
| 30 | 300274 | 阳光电源 | 90,700    | 10,435,942.00 | 0.89 |
| 31 | 002727 | 一心堂  | 298,829   | 9,894,228.19  | 0.84 |
| 32 | 002390 | 信邦制药 | 932,200   | 9,769,456.00  | 0.83 |
| 33 | 300775 | 三角防务 | 238,093   | 9,095,152.60  | 0.77 |
| 34 | 300122 | 智飞生物 | 47,237    | 8,820,565.01  | 0.75 |
| 35 | 688580 | 伟思医疗 | 49,282    | 8,254,735.00  | 0.70 |
| 36 | 002475 | 立讯精密 | 178,800   | 8,224,800.00  | 0.70 |
| 37 | 300171 | 东富龙  | 199,900   | 8,125,935.00  | 0.69 |
| 38 | 688626 | 翔宇医疗 | 61,460    | 7,426,826.40  | 0.63 |
| 39 | 300408 | 三环集团 | 173,900   | 7,376,838.00  | 0.63 |
| 40 | 002371 | 北方华创 | 26,183    | 7,262,640.54  | 0.62 |
| 41 | 300896 | 爱美客  | 8,951     | 7,061,264.88  | 0.60 |
| 42 | 601567 | 三星医疗 | 293,200   | 6,245,160.00  | 0.53 |
| 43 | 603893 | 瑞芯微  | 43,600    | 6,080,456.00  | 0.52 |
| 44 | 300447 | 全信股份 | 289,100   | 4,582,235.00  | 0.39 |
| 45 | 600329 | 中新药业 | 160,700   | 4,514,063.00  | 0.38 |
| 46 | 600809 | 山西汾酒 | 9,700     | 4,345,600.00  | 0.37 |
| 47 | 002129 | 中环股份 | 108,400   | 4,184,240.00  | 0.36 |
| 48 | 688005 | 容百科技 | 31,471    | 3,814,285.20  | 0.32 |
| 49 | 688099 | 晶晨股份 | 33,295    | 3,735,699.00  | 0.32 |
| 50 | 300820 | 英杰电气 | 66,600    | 3,642,354.00  | 0.31 |
| 51 | 603986 | 兆易创新 | 19,100    | 3,588,890.00  | 0.30 |
| 52 | 002709 | 天赐材料 | 33,060    | 3,523,534.80  | 0.30 |
| 53 | 300480 | 光力科技 | 137,400   | 3,517,440.00  | 0.30 |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 54 | 002821 | 凯莱英  | 6,900   | 2,570,940.00 | 0.22 |
| 55 | 688301 | 奕瑞科技 | 8,383   | 2,347,240.00 | 0.20 |
| 56 | 688286 | 敏芯股份 | 13,306  | 1,854,590.28 | 0.16 |
| 57 | 688425 | 铁建重工 | 135,282 | 642,589.50   | 0.05 |
| 58 | 301015 | 百洋医药 | 4,614   | 251,115.78   | 0.02 |
| 59 | 688601 | 力芯微  | 1,174   | 216,133.40   | 0.02 |
| 60 | 688630 | 芯碁微装 | 3,397   | 198,452.74   | 0.02 |
| 61 | 301013 | C利和兴 | 4,704   | 168,966.51   | 0.01 |
| 62 | 301002 | 崧盛股份 | 2,001   | 159,001.62   | 0.01 |
| 63 | 301006 | 迈拓股份 | 5,051   | 125,719.39   | 0.01 |
| 64 | 688639 | 华恒生物 | 2,302   | 97,328.56    | 0.01 |
| 65 | 688201 | 信安世纪 | 2,129   | 96,677.89    | 0.01 |
| 66 | 301004 | C嘉益  | 3,115   | 90,654.98    | 0.01 |
| 67 | 688499 | 利元亨  | 2,149   | 83,488.65    | 0.01 |
| 68 | 301011 | 华立科技 | 1,750   | 79,474.50    | 0.01 |
| 69 | 301018 | 申菱环境 | 7,811   | 64,753.19    | 0.01 |
| 70 | 301007 | 德迈仕  | 3,022   | 60,305.15    | 0.01 |
| 71 | 300995 | 奇德新材 | 1,909   | 57,368.52    | 0.00 |
| 72 | 300992 | 泰福泵业 | 1,998   | 55,828.42    | 0.00 |
| 73 | 688087 | 英科再生 | 2,469   | 54,219.24    | 0.00 |
| 74 | 601156 | 东航物流 | 2,090   | 49,470.30    | 0.00 |
| 75 | 301017 | 漱玉平民 | 5,550   | 49,173.00    | 0.00 |
| 76 | 688260 | 昀冢科技 | 2,990   | 49,065.90    | 0.00 |
| 77 | 301020 | 密封科技 | 4,210   | 44,794.40    | 0.00 |
| 78 | 300973 | 立高食品 | 360     | 41,655.60    | 0.00 |
| 79 | 688681 | 科汇股份 | 1,899   | 34,903.62    | 0.00 |
| 80 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230   | 34,721.10    | 0.00 |
| 81 | 605089 | 味知香  | 370     | 32,197.40    | 0.00 |
| 82 | 688367 | 工大高科 | 1,717   | 30,802.98    | 0.00 |
| 83 | 001207 | 联科科技 | 682     | 22,581.02    | 0.00 |
| 84 | 300941 | 创识科技 | 399     | 19,926.06    | 0.00 |
| 85 | 688226 | 威腾电气 | 2,693   | 17,289.06    | 0.00 |
| 86 | 300982 | 苏文电能 | 317     | 14,356.93    | 0.00 |
| 87 | 300968 | 格林精密 | 1,162   | 14,025.34    | 0.00 |
| 88 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754   | 13,558.42    | 0.00 |
| 89 | 300614 | 百川畅银 | 329     | 13,285.02    | 0.00 |
| 90 | 603171 | 税友股份 | 637     | 12,230.40    | 0.00 |
| 91 | 605287 | 德才股份 | 349     | 11,014.44    | 0.00 |
| 92 | 300996 | 普联软件 | 241     | 10,177.43    | 0.00 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 93  | 300917 | 特发服务 | 365   | 10,095.90 | 0.00 |
| 94  | 300956 | 英力股份 | 371   | 9,571.80  | 0.00 |
| 95  | 300962 | 中金辐照 | 576   | 9,429.12  | 0.00 |
| 96  | 300961 | 深水海纳 | 394   | 8,695.58  | 0.00 |
| 97  | 300950 | 德固特  | 219   | 8,569.47  | 0.00 |
| 98  | 605162 | 新中港  | 1,377 | 8,358.39  | 0.00 |
| 99  | 300986 | 志特新材 | 264   | 8,070.48  | 0.00 |
| 100 | 300978 | 东箭科技 | 593   | 8,064.80  | 0.00 |
| 101 | 300993 | 玉马遮阳 | 410   | 7,908.90  | 0.00 |
| 102 | 300991 | 创益通  | 254   | 6,733.54  | 0.00 |
| 103 | 300943 | 春晖智控 | 255   | 5,867.55  | 0.00 |
| 104 | 300960 | 通业科技 | 234   | 5,396.04  | 0.00 |
| 105 | 605011 | 杭州热电 | 525   | 4,662.00  | 0.00 |
| 106 | 00460  | 四环医药 | 119   | 328.74    | 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  | 300601 | 康泰生物 | 70,772,658.67 | 1.85           |
| 2  | 000661 | 长春高新 | 66,198,922.00 | 1.73           |
| 3  | 03690  | 美团-W | 65,367,817.88 | 1.71           |
| 4  | 601012 | 隆基股份 | 60,875,417.90 | 1.60           |
| 5  | 603799 | 华友钴业 | 56,662,672.40 | 1.48           |
| 6  | 03347  | 泰格医药 | 54,618,310.05 | 1.43           |
| 7  | 300014 | 亿纬锂能 | 52,869,898.30 | 1.39           |
| 8  | 00981  | 中芯国际 | 44,644,949.24 | 1.17           |
| 9  | 600309 | 万华化学 | 40,629,274.25 | 1.06           |
| 10 | 600031 | 三一重工 | 39,540,909.00 | 1.04           |
| 11 | 300015 | 爱尔眼科 | 39,414,172.92 | 1.03           |
| 12 | 600399 | 抚顺特钢 | 36,466,448.40 | 0.96           |
| 13 | 688202 | 美迪西  | 34,679,730.79 | 0.91           |
| 14 | 300347 | 泰格医药 | 33,762,950.00 | 0.88           |
| 15 | 002415 | 海康威视 | 32,834,238.85 | 0.86           |
| 16 | 300750 | 宁德时代 | 32,728,804.00 | 0.86           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 17 | 600176 | 中国巨石 | 32,415,791.58 | 0.85 |
| 18 | 600519 | 贵州茅台 | 31,345,210.00 | 0.82 |
| 19 | 603338 | 浙江鼎力 | 30,789,830.00 | 0.81 |
| 20 | 600132 | 重庆啤酒 | 30,777,748.56 | 0.81 |

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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  | 300122 | 智飞生物 | 222,347,074.00 | 5.83           |
| 2  | 300601 | 康泰生物 | 186,220,583.85 | 4.88           |
| 3  | 300274 | 阳光电源 | 175,240,891.91 | 4.59           |
| 4  | 603233 | 大参林  | 163,222,716.89 | 4.28           |
| 5  | 603456 | 九洲药业 | 141,300,630.51 | 3.70           |
| 6  | 600276 | 恒瑞医药 | 136,414,517.93 | 3.57           |
| 7  | 603799 | 华友钴业 | 100,739,297.37 | 2.64           |
| 8  | 600519 | 贵州茅台 | 97,957,814.00  | 2.57           |
| 9  | 601318 | 中国平安 | 95,255,506.37  | 2.50           |
| 10 | 000858 | 五粮液  | 75,781,281.23  | 1.99           |
| 11 | 002727 | 一心堂  | 72,405,252.34  | 1.90           |
| 12 | 300014 | 亿纬锂能 | 69,501,680.89  | 1.82           |
| 13 | 603883 | 老百姓  | 67,789,547.02  | 1.78           |
| 14 | 000661 | 长春高新 | 67,010,317.00  | 1.76           |
| 15 | 300073 | 当升科技 | 66,664,493.70  | 1.75           |
| 16 | 300750 | 宁德时代 | 65,720,954.16  | 1.72           |
| 17 | 601166 | 兴业银行 | 65,270,981.50  | 1.71           |
| 18 | 000001 | 平安银行 | 63,244,517.14  | 1.66           |
| 19 | 03690  | 美团-W | 61,079,529.99  | 1.60           |
| 20 | 603392 | 万泰生物 | 57,705,202.19  | 1.51           |

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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 | 2,719,407,262.85 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 5,021,588,787.53 |

注：买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。



## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行股指期货投资，期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

## 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

注：本基金投资于国债期货，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期本基金投资的前十名证券除腾讯控股发行主体外，其他证券的发行主体未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。

根据国家市场监督管理总局公布的行政处罚决定书：腾讯控股有限公司（简称腾讯控股）因

违法实施经营者集中案，于 2021 年 4 月 28 日被国家市场监督管理总局处以罚款。

本基金管理小组分析认为，相关违规事项已经调查完毕，行政处罚决定也已经开出。考虑到此次处罚金额相对上一年的经营利润占比较小，对于公司的未来财务并无重大影响。本基金经理依据基金合同和本公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对腾讯控股进行了投资。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,093,958.25  |
| 2  | 应收证券清算款 | 36,733,914.88 |
| 3  | 应收股利    | 134,835.58    |
| 4  | 应收利息    | 27,253.02     |
| 5  | 应收申购款   | 177,266.10    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 38,167,227.83 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 54,163       | 18,919.93     | 1,150,821.78 | 0.11%      | 1,023,609,114.50 | 99.89%     |

### 8.2 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 | 132,053.45 | 0.0129%  |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 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 | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                  |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（ 2020 年 6 月 23 日 ）基金份额总额 | 5,901,353,494.87 |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 3,546,138,266.41 |
| 本报告期基金总申购份额                      | 97,988,173.85    |
| 减：本报告期基金总赎回份额                    | 2,619,366,503.98 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）         | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                     | 1,024,759,936.28 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

1、基金管理人重大人事变动

自 2021 年 4 月 13 日起，许明波先生不再担任公司董事，由曾晓玲女士担任公司董事。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，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

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易             |              | 应支付该券商的佣金    |            | 备注 |
|--------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
|        |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 长城证券   | 1      | 1,713,218,599.28 | 22.15%       | 1,495,612.02 | 21.05%     | —  |
| 国信证券   | 2      | 1,605,621,407.10 | 20.75%       | 1,495,312.39 | 21.05%     | —  |
| 中信建投   | 2      | 1,222,029,341.11 | 15.80%       | 1,138,069.57 | 16.02%     | —  |
| 安信证券   | 2      | 748,935,214.11   | 9.68%        | 697,483.89   | 9.82%      | —  |
| 东方财富证券 | 2      | 739,586,003.01   | 9.56%        | 688,777.48   | 9.69%      | —  |
| 浙商证券   | 1      | 557,319,276.72   | 7.20%        | 519,032.80   | 7.31%      | —  |
| 方正证券   | 2      | 521,984,399.65   | 6.75%        | 486,122.15   | 6.84%      | —  |

|      |   |                |       |            |       |   |
|------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 中泰证券 | 2 | 364,788,794.72 | 4.72% | 339,727.16 | 4.78% | - |
| 光大证券 | 1 | 89,034,046.24  | 1.15% | 82,917.89  | 1.17% | - |
| 开源证券 | 2 | 84,137,739.81  | 1.09% | 78,357.37  | 1.10% | - |
| 东北证券 | 2 | 68,506,283.44  | 0.89% | 63,799.66  | 0.90% | - |
| 上海证券 | 2 | 21,016,624.00  | 0.27% | 19,572.79  | 0.28% | - |
| 华泰证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 广发证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 长江证券 | 2 | -              | -     | -          | -     | - |
| 平安证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 申万宏源 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 华西证券 | 2 | -              | -     | -          | -     | - |
| 海通证券 | 2 | -              | -     | -          | -     | - |
| 信达证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 华鑫证券 | 2 | -              | -     | -          | -     | - |

注：1、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内新增 4 个专用交易单元（上海证券、中泰证券各新增 2 个交易单元），截止本报告期末共计 34 个交易单元。

## 2、专用交易单元的选择标准和程序

本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金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、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易         |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|--------|--------------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|        | 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 |
| 长城证券   | 7,695,883.73 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            |
| 国信证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中信建投   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 安信证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东方财富证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 浙商证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 方正证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中泰证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 光大证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 开源证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东北证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 上海证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华泰证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 广发证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长江证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 平安证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 申万宏源   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华西证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 海通证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 信达证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华鑫证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |

### 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  | 长城基金管理有限公司关于参加宁波银行费率优惠活动的公告    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2021 年 1 月 27 日 |
| 2  | 关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告 | 本基金管理人网站                       | 2021 年 2 月 8 日  |

|   |                                       |                                |                 |
|---|---------------------------------------|--------------------------------|-----------------|
| 3 | 长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(盛达资源) | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2021 年 2 月 23 日 |
| 4 | 长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低申购金额限制的公告       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2021 年 4 月 27 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**

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### **11.2 影响投资者决策的其他重要信息**

注：本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予长城创新驱动混合型证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城创新驱动混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城创新驱动混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件 营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件 营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网站：[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)