

景顺长城大中华混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 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：2022 年 3 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2022 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 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	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.10 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	15
§5 托管人报告	15
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21

§8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况.....	43
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	44
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	44
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	44
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	46
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	50
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	50
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	50
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	50
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	50
8.11 投资组合报告附注	50
§9 基金份额持有人信息	51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	52
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.....	52
§10 开放式基金份额变动	52
§11 重大事件揭示	52
11.1 基金份额持有人大会决议	52
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.....	52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
11.4 基金投资策略的改变	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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.....	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
11.8 其他重大事件	57
§12 影响投资者决策的其他重要信息	62
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.....	62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§13 备查文件目录	63
13.1 备查文件目录	63
13.2 存放地点	63
13.3 查阅方式.....	63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城大中华混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城大中华混合（QDII）
基金主代码	262001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 22 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	596,968,770.58 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于除内地以外的大中华地区证券市场以及海外证券市场交易的大中华企业，追求长期资本增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的资产配置与“自下而上”的选股相结合的投资策略，在实际投资组合的构建上更偏重“自下而上”的部分，重点投资于处于合理价位的成长型股票（Growth at Reasonable Price, GARP）以及受惠于盈利周期加速且估值便宜的品质型股票（value + catalyst）。
业绩比较基准	摩根斯坦利金龙净总收益指数（MSCI Golden Dragon Net Total Return Index）。
风险收益特征	本基金是混合型基金，属于高预期风险、高预期收益的投资品种。其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。同时，本基金投资的目标市场是海外市场，除了需要承担市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、不同地区以及国别风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

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
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95588
传真	0755-22381339	(010) 66105798
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140

法定代表人	李进	陈四清
-------	----	-----

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Invesco Hong Kong Limited	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	景顺投资管理有限公司	渣打银行（香港）有限公司
注册地址		香港中环花园道三号冠君大厦 41 楼	香港中环德辅道中四至四 A 渣打银行大厦三十二楼
办公地址		香港中环花园道三号冠君大厦 41 楼	香港九龙官塘道 388 号渣打中心十五楼
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	-142,868,431.09	50,428,467.50	18,427,457.69
本期利润	-399,481,944.89	161,745,557.06	37,416,972.74
加权平均基金份额本期利润	-0.6004	0.9063	0.2896
本期加权平均净值利润率	-24.91%	46.04%	19.85%
本期基金份额净值增长率	-15.21%	62.21%	25.07%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	220,084,941.07	136,312,178.47	46,895,012.32
期末可供分配基金份额利润	0.3687	0.5689	0.4597
期末基金资产净值	1,201,053,278.17	568,716,800.62	163,159,710.70
期末基金份额净值	2.012	2.373	1.600
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末

基金份额累计净值增长率	159.47%	206.03%	88.67%
-------------	---------	---------	--------

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。

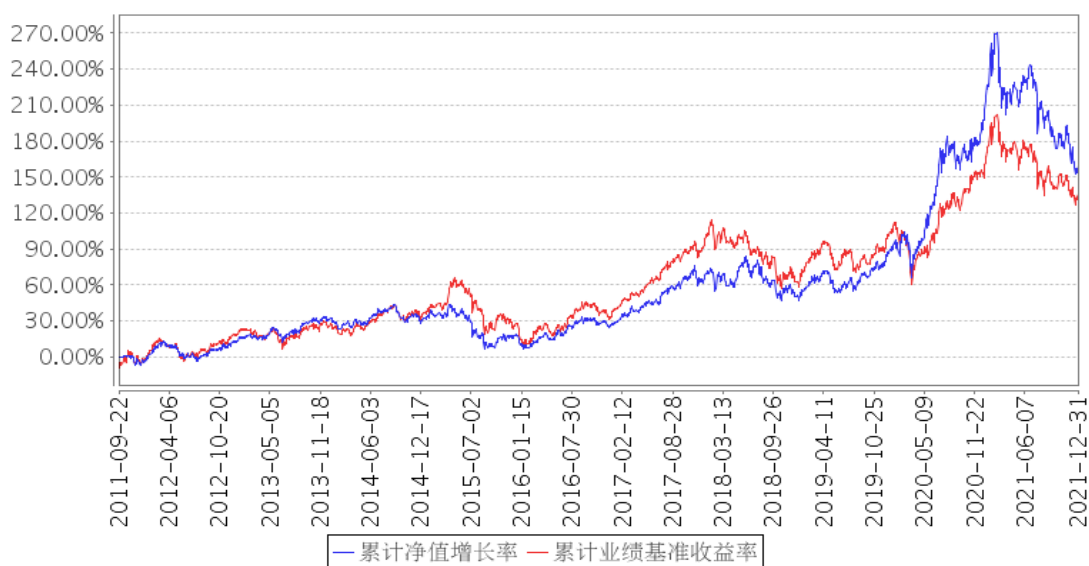
3.2 基金净值表现

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	-8.17%	1.32%	-1.91%	0.92%	-6.26%	0.40%
过去六个月	-24.22%	1.51%	-14.98%	1.23%	-9.24%	0.28%
过去一年	-15.21%	1.63%	-9.47%	1.28%	-5.74%	0.35%
过去三年	72.01%	1.51%	44.46%	1.28%	27.55%	0.23%
过去五年	105.62%	1.36%	75.94%	1.19%	29.68%	0.17%
自基金合同生效起至今	159.47%	1.14%	135.40%	1.16%	24.07%	-0.02%

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

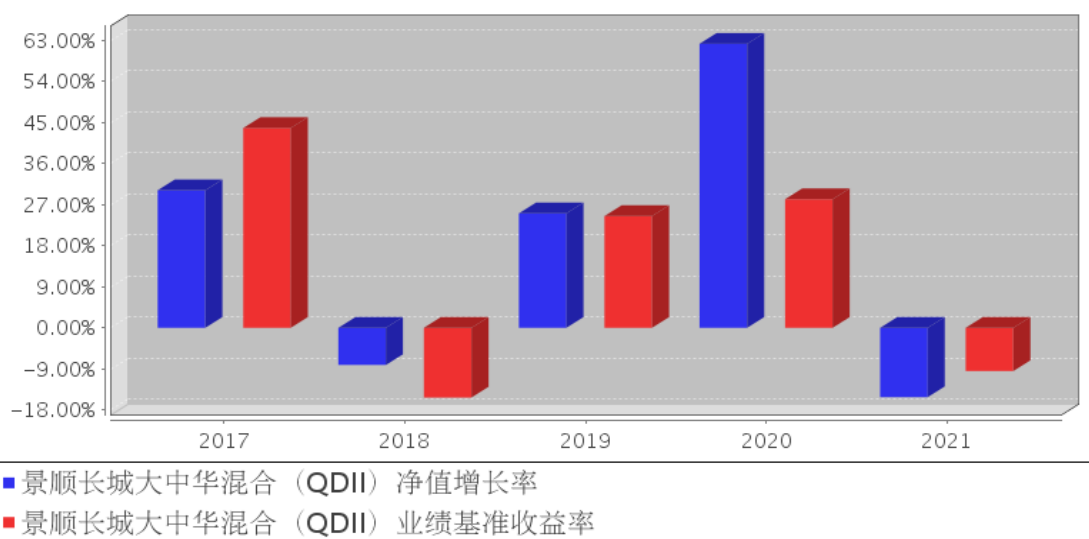
景顺长城大中华混合（QDII）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的资产配置比例为：股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的 60%，其中投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及在其他证券市场交易的大中华企业的资产不低于基金股票及其他权益类资产的 80%；持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2011 年 9 月 22 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。本基金自 2020 年 12 月 8 日起增设美元基金份额。

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

景顺长城大中华混合（QDII）基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	1.7300	25,885,172.57	2,130,198.09	28,015,370.66	二次分红
2019 年	0.7200	6,811,869.39	474,972.02	7,286,841.41	一次分红
合计	2.4500	32,697,041.96	2,605,170.11	35,302,212.07	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2021年12月31日，本公司旗下共管理140只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周寒颖	本基金的基金经理	2016年6月3日	-	15年	工商管理硕士。曾任招商基金研究部研究员、高级研究员、国际业务部高级研究员。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。具有15年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公

司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
萧光一 (MikeShiao)	首席投资总监	29	美国宾夕法尼亚州卓克索大学 (Drexel University) 金融理学硕士。2002 年加盟景顺，并于 2015 年出任大中华首席投资总监，带领大中华区股票团队，并于 2016 年 4 月担任亚洲区(日本除外)的首席投资总监。萧先生自 2008 年起已为景顺大中华基金的首席基金经理，并于 2014 年 7 月起担任亚洲机遇股票投资组合的首席基金经理。他同时负责中国智选股票等投资组合，以及投资于中国香港/大陆的机构客户投资组合。在此之前，萧先生为中国台湾景顺投信的股票部主管，其后于 2006 年加入位于中国香港的景顺投资管理有限公司，以拓展其覆盖至大中华市场。萧先生在 1992 年开始投身投资业界，在 Grand Regent Investment Ltd. 担任项目经理达六年之久，管理中国台湾及大陆的创业基金的活动。他于 1997 年加盟 Overseas Credit and Securities Inc.，担任高级分析员，负责研究中国台湾的科技板块。萧先生亦曾于 Taiwan International Investment Management Co. 担任基金经理，负责科技业的研究工作。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城大中华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，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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

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

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

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

2、交易执行的内部控制

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

3、交易指令分配的控制

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

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

4、公平交易监控

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

5 日内) 公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析, 对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释, 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, 并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.4.2 公平交易制度的执行情况

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

4.4.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内, 本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价, 同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 25 次, 为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易, 按规定履行了审批程序。

本报告期内, 未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年 MSCI 金龙指数下跌 11.02%, 台湾加权指数上涨 23.66%, 恒生指数下跌 14.08%, 上证指数上涨 4.80%。同期, 纳斯达克指数上涨 21.39%, 标普 500 上涨 26.89%。2021, 人民币兑美元升值 2.55%, 12 月 31 日离岸市场人民币对美金汇率 6.35。

2021 年中国实现了 5.1% 的 GDP 增长。在总量增速放缓的情况下, 结构转型突出。具体表现为, 绿色转型、“双碳”投资、高端制造业保持高增长动能, 而传统高耗能产业成为拖累; 房地产和传统基建落后于疫情前水平; 线上消费和线下消费分别面临着疫情催生下高基数和短期疫情反复及经济下行的需求抑制问题。相较而言, 政策层面的信号较为积极。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年度, 本基金份额净值增长率为-15.21%, 业绩比较基准收益率为-9.47%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外市场方面，2021 年美国消费强劲复苏，预计 2022 年增速或边际走弱。但随着美联储加快 Taper 的落地以及不断对外释放鹰派言论应对通胀，市场对于美联储加息的预期不断升温，目前市场较为激进预期是 3 月开始加息、全年加 3-4 次。受此影响，今年年初以来，美国长债利率上行影响，美股短期回调明显。考虑到海外经济基本面的趋弱，以及参考中国疫情之后的经济周期与政策演化，预计美联储等海外央行的政策推演将不及当前的市场预期，资本市场也在定价政策与经济之间的矛盾，目前的政策更多基于应对预期发酵，我们认为政策在初期加快退出之后将趋于缓和。而在 2022 年上半年，为主要应对通胀预期，海外政策取向将趋于紧缩，需要警惕美股波动以及美元走高对于新兴市场的冲击，下半年可能反而面临相对友好的外部环境。

国内方面，年初以来，中央稳增长信号增加，包括房地产政策边际纠偏、推行全面降准和结构性货币政策工具，预计至少未来一个季度宽信用的政策意图还是比较明确。此外，政府将更好地平衡经济增长与绿色转型的矛盾。从已公布的地方经济工作部署来看，所有省级行政区域经济目标均高于 5%，多地要求“千方百计扩大有效投资”，综合交通网络、旧城改造、保障性租赁住房建设、重大产业项目（新能源化、智能化转型）、数字经济、新型电力系统等领域是稳增长的主要发力点。但需求端除制造业投资外，对经济复苏的制约愈发明显，需要货币、财政、产业政策多措并举，市场对于 2022 年的经济增长目标仍有疑虑，更加具体的、细节的稳增长政策工具仍未明确，我们会继续关注未来稳增长落地的情况。

一季度面临美债走高，海外流动性收紧的宏观背景，全球高估值成长股仍有压力。现在港股成长股估值已经从高点回落了很多，但由于缺乏流动性，部分出现了超跌，持有一年的股票投资回报率已经很有吸引力，我们将逐步加仓这些高性价比股票。业绩看全年前低后高，年报和一季报前后会是市场预期稳定窗口，叠加美国更加清晰的政策节奏，港股的投资机会会日渐明朗。年初海外资金年度调仓和抛售处置风险都是暂时的，最痛苦时期最终会离我们远去。我们看好港股高股息资产和低估值资产的防御价值，以及成长股下跌带来长期投资机会。

4.7 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。

4.8 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、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。

相关定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.9 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。

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

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资

产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，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本基金 2021 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(2022)第 24439 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	景顺长城大中华混合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大中华混合型证券投资基金(以下简称“景顺长城大中华基金”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 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实务操作编制，公允反映了景顺长城大中华基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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大中华基金，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	景顺长城大中华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

	<p>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大中华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大中华基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督景顺长城大中华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，就可能对景顺长城大中华基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城大中华基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 郭劲扬
会计师事务所的地址	中国 上海市

审计报告日期	2022 年 3 月 24 日
--------	-----------------

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城大中华混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	304,264,191.16	68,379,961.88
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	909,721,512.08	528,341,297.93
其中：股票投资		909,721,512.08	528,341,297.93
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	17,190.98	2,810.17
应收股利		356,378.91	226,712.61
应收申购款		1,954,043.51	8,850,010.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,216,313,316.64	605,800,792.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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		78.36	28,528,125.42
应付赎回款		12,575,141.27	7,407,637.12
应付管理人报酬		1,872,629.79	791,989.09
应付托管费		364,122.47	153,997.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	201,755.32	-

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	246,311.26	202,242.87
负债合计		15,260,038.47	37,083,992.37
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	596,968,770.58	239,616,056.07
未分配利润	7.4.7.10	604,084,507.59	329,100,744.55
所有者权益合计		1,201,053,278.17	568,716,800.62
负债和所有者权益总计		1,216,313,316.64	605,800,792.99

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 596,968,770.58 份，其中人民币基金份额净值人民币 2.012 元，基金份额总额 593,936,854.74 份；美元基金份额净值美元 0.316 元，基金份额总额 3,031,915.84 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城大中华混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 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
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		-348,971,893.72	172,485,525.62
1. 利息收入		542,367.02	97,091.72
其中：存款利息收入	7.4.7.11	542,367.02	97,091.72
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-90,697,776.50	63,029,494.11
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-126,864,735.54	60,799,366.32
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-

股利收益	7.4.7.16	36,166,959.04	2,230,127.79
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-256,613,513.80	111,317,089.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-4,260,876.20	-2,380,629.28
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,057,905.76	422,479.51
减：二、费用		50,510,051.17	10,739,968.56
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	28,952,473.14	6,260,814.53
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,629,647.58	1,217,380.57
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	15,676,338.62	3,055,033.91
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	251,591.83	206,739.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-399,481,944.89	161,745,557.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-399,481,944.89	161,745,557.06

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城大中华混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	239,616,056.07	329,100,744.55	568,716,800.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-399,481,944.89	-399,481,944.89
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）	357,352,714.51	674,465,707.93	1,031,818,422.44
其中：1. 基金申购款	979,949,921.75	1,575,824,661.07	2,555,774,582.82
2. 基金赎回款	-622,597,207.24	-901,358,953.14	-1,523,956,160.38
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）	596,968,770.58	604,084,507.59	1,201,053,278.17
项目	上年度可比期间 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）	102,003,188.43	61,156,522.27	163,159,710.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	161,745,557.06	161,745,557.06
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）	137,612,867.64	134,214,035.88	271,826,903.52
其中：1. 基金申购款	288,868,988.60	286,344,145.14	575,213,133.74
2. 基金赎回款	-151,256,120.96	-152,130,109.26	-303,386,230.22
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）	-	-28,015,370.66	-28,015,370.66
五、期末所有者权益（基金净值）	239,616,056.07	329,100,744.55	568,716,800.62

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

景顺长城大中华混合型证券投资基金(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[2011]第 709 号《关于核准景顺长城大中华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《景顺长城大中华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 291,060,560.03 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 367 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城大中华股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基

基金份额总额为 291,092,562.55 份基金份额，其中认购资金利息折合 32,002.52 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，境外资产托管人为渣打银行（香港）有限公司（Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited）。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，景顺长城大中华股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 5 日公告后更名为景顺长城大中华混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为股票及其他权益类证券、现金、债券、股指期货及中国证监会允许投资的其它金融工具。本基金对于股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的 60%，其中投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及在其他证券市场交易的大中华企业的资产不低于基金股票及其他权益类资产的 80%；持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例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：摩根斯坦利金龙净总收益指数（MSCI Golden Dragon Net Total Return Index）。

根据本基金的基金管理人景顺长城基金管理股份有限公司于 2020 年 12 月 8 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城大中华混合型证券投资基金增设美元基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告》和更新后的《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》，自 2020 年 12 月 8 日起，本基金根据申购、赎回所使用货币的不同，在现有人民币基金份额的基础上增设美元基金份额，原有基金份额将自动划归为本基金人民币基金份额。本基金以人民币计价并进行申购、赎回的份额类别，称为人民币基金份额；以美元计价并进行申购、赎回的份额类别，称为美元基金份额。本基金对人民币基金份额和美元基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值和基金份额累计净值。人民币基金份额和美元基金份额合并投资运作，共同承担投资换汇产生的费用及其他相关费用。投资者在申购基金份额时可自行选择基金份额类别，并交付相应币种的款项。

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 2022 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》、本基金基金合同和在财务报表附注

所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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、基金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、基金投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占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股票交易所在地适用的预缴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。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除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

本基金同一类别的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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税

务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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) 目前基金取得的其他源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	304,264,191.16	68,379,961.88
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以 内	-	-
存款期限 1 个月（含） -3 个月	-	-
存款期限 3 个月（含） 至 1 年	-	-
存款期限 1 年（含）以 上	-	-
其他存款	-	-
合计	304,264,191.16	68,379,961.88

注：于 2021 年 12 月 31 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 139,070,691.75 元(折合人民币 113,704,197.57 元)，美元 662,164.70 元(折合人民币 4,221,763.48 元)，新台币 111,520,906.00 元(折合人民币 25,695,632.26 元)(2020 年 12 月 31 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 41,356,862.18 元(折合人民币 34,807,589.49 元)，美元 1,001,563.80 元(折合人民币 6,535,103.64 元)，新台币 541,262.00 元(折合人民币 125,704.94 元))

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,034,211,058.49	909,721,512.08	-124,489,546.41
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	1,034,211,058.49	909,721,512.08	-124,489,546.41
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	396,217,330.54	528,341,297.93	132,123,967.39
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		396,217,330.54	528,341,297.93	132,123,967.39

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的衍生金融资产/负债余额为零。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末的买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末从买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	16,350.59	2,810.17
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	840.39	-
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	-	-
合计	17,190.98	2,810.17

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末的其他资产余额为零。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日

交易所市场应付交易费用	201,755.32	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	201,755.32	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	46,311.26	27,242.87
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	200,000.00	175,000.00
合计	246,311.26	202,242.87

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	239,616,056.07	239,616,056.07
本期申购	979,949,921.75	979,949,921.75
本期赎回（以“-”号填列）	-622,597,207.24	-622,597,207.24
- 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	596,968,770.58	596,968,770.58

注：申购含红利再投、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	136,312,178.47	192,788,566.08	329,100,744.55
本期利润	-142,868,431.09	-256,613,513.80	-399,481,944.89
本期基金份额交易产生的变动数	226,641,193.69	447,824,514.24	674,465,707.93
其中：基金申购款	612,990,908.28	962,833,752.79	1,575,824,661.07
基金赎回款	-386,349,714.59	-515,009,238.55	-901,358,953.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	220,084,941.07	383,999,566.52	604,084,507.59

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	476,913.56	96,955.49
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	50,545.93	80.75
其他	14,907.53	55.48
合计	542,367.02	97,091.72

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	3,581,613,560.78	596,708,608.44
减：卖出股票成本总额	3,708,478,296.32	535,909,242.12
买卖股票差价收入	-126,864,735.54	60,799,366.32

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	36,166,959.04	2,230,127.79
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	36,166,959.04	2,230,127.79

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-256,613,513.80	111,317,089.56
股票投资	-256,613,513.80	111,317,089.56

债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-256,613,513.80	111,317,089.56

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	2,057,905.76	422,479.51
合计	2,057,905.76	422,479.51

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	15,676,338.62	3,055,033.91
银行间市场交易费用	-	-
合计	15,676,338.62	3,055,033.91

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	80,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
税务代理费	23,101.93	20,909.08
银行划款手续费	28,489.90	10,830.47
合计	251,591.83	206,739.55

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
渣打银行（香港）有限公司（“渣打银行（香港）”）	境外资产托管人
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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	23,216,084.94	0.30	-	-

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021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	18,572.71	0.26	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	28,952,473.14	6,260,814.53
其中：支付销售机构的客户维护费	7,325,031.82	1,227,994.32

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 1.80%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.80\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,629,647.58	1,217,380.57

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.35%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.35\% / \text{当年天数}。$$

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均未发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
渣打银行-活期	139,405,002.74	20,984.69	34,938,554.47	2,713.66
中国工商银行-活期	164,859,188.42	455,928.87	33,441,407.41	94,241.83

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人渣打银行保管，按适用利率或约定利率计息。

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(2021 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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金未持有除国债、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（上年度末：同）。

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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	278,557,327.08	-	-	-	-	25,706,864.08	304,264,191.16
交易性金融资产	-	-	-	-	-	909,721,512.08	909,721,512.08
应收利息	-	-	-	-	-	17,190.98	17,190.98
应收股利	-	-	-	-	-	356,378.91	356,378.91
应收申购款	15,850.39	-	-	-	-	1,938,193.12	1,954,043.51
资产总计	278,573,177.47	-	-	-	-	937,740,139.17	1,216,313,316.64
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,575,141.27	12,575,141.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,872,629.79	1,872,629.79
应付托管费	-	-	-	-	-	364,122.47	364,122.47
应付证券清算款	-	-	-	-	-	78.36	78.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	201,755.32	201,755.32
其他负债	-	-	-	-	-	246,311.26	246,311.26
负债总计	-	-	-	-	-	15,260,038.47	15,260,038.47
利率敏感度缺口	278,573,177.47	-	-	-	-	-	-
上年度末 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	33,441,407.41	-	-	-	-	34,938,554.47	68,379,961.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-	528,341,297.93	528,341,297.93
应收利息	-	-	-	-	-	2,810.17	2,810.17
应收股利	-	-	-	-	-	226,712.61	226,712.61
应收申购款	14.90	-	-	-	-	8,849,995.50	8,850,010.40
资产总计	33,441,422.31	-	-	-	-	572,359,370.68	605,800,792.99
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,407,637.12	7,407,637.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	791,989.09	791,989.09
应付托管费	-	-	-	-	-	153,997.87	153,997.87
应付证券清算款	-	-	-	-	-	28,528,125.42	28,528,125.42
其他负债	-	-	-	-	-	202,242.87	202,242.87
负债总计	-	-	-	-	-	37,083,992.37	37,083,992.37
利率敏感度缺口	33,441,422.31	-	-	-	-	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	4,221,763.48	113,704,197.57	25,695,632.26	143,621,593.31
交易性金融资产	23,295,157.38	815,716,705.81	70,709,648.89	909,721,512.08
应收利息	12.62	-	-	12.62
应收股利	-	-	249,783.27	249,783.27
资产合计	27,516,933.48	929,420,903.38	96,655,064.42	1,053,592,901.28
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	27,516,933.48	929,420,903.38	96,655,064.42	1,053,592,901.28
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	6,535,103.64	34,807,589.49	125,704.94	41,468,398.07
交易性金融资产	21,680,098.09	468,872,750.69	37,788,449.15	528,341,297.93
应收利息	1.83	-	-	1.83
应收股利	-	105,945.64	120,766.97	226,712.61
资产合计	28,215,203.56	503,786,285.82	38,034,921.06	570,036,410.44

以外币计价的负债				
应付证券清算款	1,097,190.58	27,430,928.49	-	28,528,119.07
负债合计	1,097,190.58	27,430,928.49	-	28,528,119.07
资产负债表外汇风险敞口净额	27,118,012.98	476,355,357.33	38,034,921.06	541,508,291.37

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率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 （2021年12月31日）	上年度末 （2020年12月31日）
分析	所有外币均相对人民币升值 5%	52,679,645.06	27,075,414.57
	所有外币均相对人民币贬值 5%	-52,679,645.06	-27,075,414.57

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 2021年12月31日		上年度末 2020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	909,721,512.08	75.74	528,341,297.93	92.90
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	909,721,512.08	75.74	528,341,297.93	92.90

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 (2021 年 12 月 31 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
分析	沪深 300 指数上升 5%	58,667,105.07	22,717,062.27
	沪深 300 指数下降 5%	-58,667,105.07	-22,717,062.27

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 2021 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 909,721,512.08 元，无属于第二或第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 528,341,297.93 元，无第二或第三层次)。

(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；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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 2021 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(2020 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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外，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	909,721,512.08	74.79
	其中：普通股	886,426,354.70	72.88
	存托凭证	23,295,157.38	1.92
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	304,264,191.16	25.02
8	其他各项资产	2,327,613.40	0.19
9	合计	1,216,313,316.64	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 364,941,248.54 元，占基金资产净值比例为 30.39%。

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	815,716,705.81	67.92
中国台湾	70,709,648.89	5.89
美国	23,295,157.38	1.94
合计	909,721,512.08	75.74

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
周期性消费品	85,664,324.51	7.13
非周期性消费品	158,894,971.71	13.21
综合	-	-
能源	-	-
金融	92,867,692.85	7.73
工业	199,875,937.12	16.64
信息技术	109,220,047.87	9.10
公用事业	-	-
通讯	263,198,538.02	21.92
合计	909,721,512.08	75.74

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比
----	----------	----------	------	--------	----------	-------	------	----------

								例(%)
1	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	东方海外 国际	316 HK	香港联合交易所	中国香港	584,000	91,341,617.92	7.61
2	CHINA MOBILE LTD	中国移动	941 HK	香港联合交易所	中国香港	1,929,000	73,810,638.72	6.15
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台积电	2330 TT	台湾证券交易所	中国台湾	499,000	70,709,648.89	5.89
4	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	171,400	64,014,417.15	5.33
5	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI	时代电气	3898 HK	香港联合交易所	中国香港	1,726,500	63,733,125.96	5.31
6	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	微创医疗	853 HK	香港联合交易所	中国香港	2,615,000	60,719,881.60	5.06
7	MEITUAN DIANPING	美团点评	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	307,200	56,612,978.69	4.71
8	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	中教控股	839 HK	香港联合交易所	中国香港	5,098,000	52,768,459.97	4.39
9	JD.com Inc.	京东	9618 HK	香港联合交易所	中国香港	202,950	45,465,346.08	3.79
10	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件 国际	354 HK	香港联合交易所	中国香港	4,636,000	38,510,398.98	3.21
11	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	福耀玻璃	3606 HK	香港联合交易所	中国香港	1,084,800	35,743,378.94	2.98
12	Hygeia Healthcare Holdings Co	海吉亚医 疗	6078 HK	香港联合交易所	中国香港	802,200	32,006,881.54	2.66
13	POLY PROPERTY DEVELOPMENT	保利物业	6049 HK	香港联合交易所	中国香港	636,400	31,895,655.23	2.66
14	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国海外 发展	688 HK	香港联合交易所	中国香港	1,953,000	29,476,425.89	2.45
15	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	华润万象 生活	1209 HK	香港联合交易所	中国香港	880,600	26,171,220.66	2.18
16	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华控股	1999 HK	香港联合交易所	中国香港	2,451,600	24,213,492.17	2.02
17	PINDUODUO INC-ADR	拼多多	PDD US	纳斯达克证券交易所	美国	43,605	16,208,122.83	1.35
18	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	申洲国际	2313 HK	香港联合交易所	中国香港	115,000	14,094,197.60	1.17
19	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学 科技	2382 HK	香港联合交易所	中国香港	64,500	13,004,500.32	1.08
20	CHINA COSCO	中远海控	1919 HK	香港联合交易所	中国香港	1,034,500	12,788,604.86	1.06

	HOLDINGS-H							
21	Morimatsu International Holdin	森松国际	2155 HK	香港联合交易所	中国香港	1,574,000	11,517,776.48	0.96
22	Wuxi Apptec Co Ltd	药明康德	2359 HK	香港联合交易所	中国香港	89,300	9,856,576.80	0.82
23	KE HOLDINGS INC	贝壳集团	BEKE US	纽约证券交易所	美国	55,247	7,087,034.55	0.59
24	Bosideng International Holdings Ltd	波司登	3998 HK	香港联合交易所	中国香港	1,744,000	7,001,141.50	0.58
25	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港交易所	388 HK	香港联合交易所	中国香港	14,300	5,324,391.07	0.44
26	Chervon Holdings Ltd	泉峰控股	2285 HK	香港联合交易所	中国香港	106,600	5,046,341.66	0.42
27	Haier Smart Home Co Ltd	海尔智家	6690 HK	香港联合交易所	中国香港	171,200	4,612,114.30	0.38
28	Remegen Co Ltd	荣昌生物	9995 HK	香港联合交易所	中国香港	53,000	3,375,625.12	0.28
29	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	海丰国际	1308 HK	香港联合交易所	中国香港	106,000	2,443,969.92	0.20
30	Shanghai MicroPort MedBot Grou	微创机器人	2252 HK	香港联合交易所	中国香港	3,500	167,546.68	0.01

注：本基金对以上证券代码采用彭博代码即 BB Ticker。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	MEITUAN DIANPING	3690 HK	230,105,507.61	40.46
2	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	202,192,698.11	35.55
3	Bilibili Inc	9626 HK	115,646,743.40	20.33
3	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	BILI US	65,625,913.97	11.54
4	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	147,319,377.56	25.90
5	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	146,290,483.43	25.72
6	CHINA MOBILE LTD	941 HK	145,703,080.06	25.62
7	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	126,490,706.77	22.24
8	JD.comInc.	9618 HK	121,964,141.34	21.45
9	WEIMOB INC	2013 HK	114,220,242.98	20.08
10	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	316 HK	114,032,945.27	20.05
11	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	97,098,068.90	17.07

11	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	13,771,707.63	2.42
12	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3606 HK	108,172,584.56	19.02
13	PINDUODUO INC-ADR	PDD US	104,139,985.10	18.31
14	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	97,221,767.58	17.09
15	MAN WAH HOLDINGS LTD	1999 HK	96,622,031.18	16.99
16	Haier Smart Home Co Ltd	6690 HK	95,603,129.33	16.81
17	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	354 HK	94,140,422.24	16.55
18	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	839 HK	93,488,484.90	16.44
19	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	92,579,045.48	16.28
20	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1308 HK	78,916,790.72	13.88
21	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	75,774,647.80	13.32
22	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2330 TT	73,047,089.00	12.84
23	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1 HK	70,099,164.40	12.33
24	FUTU HOLDINGS LIMITED	FUTU US	67,896,796.86	11.94
25	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	3898 HK	67,253,395.05	11.83
26	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	1209 HK	65,320,854.38	11.49
27	SMOOREINTERNATIONALHOLDING	6969 HK	64,371,158.93	11.32
28	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2689 HK	64,101,718.52	11.27
29	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	3908 HK	61,680,114.96	10.85
30	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	55,733,614.50	9.80
31	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	3800 HK	55,390,850.43	9.74
32	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	53,741,012.57	9.45
33	Hangzhou Tigermed Consulting C	3347 HK	53,520,557.43	9.41
34	Jinke Smart Services Group Co	9666 HK	52,192,950.86	9.18
35	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	47,167,635.67	8.29
36	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	44,895,643.92	7.89
37	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	44,107,268.66	7.76
38	Hygeia Healthcare Holdings Co	6078 HK	44,069,887.94	7.75
39	HOPE EDUCATION GROUP CO LTD	1765 HK	42,007,200.18	7.39
40	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	41,470,145.39	7.29
41	TAL EDUCATION GROUP- ADR	TAL US	38,638,559.60	6.79
42	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	37,528,348.03	6.60
43	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	968 HK	36,544,097.27	6.43
44	NAYUKI HOLDINGS LIMITED	2150 HK	35,649,117.37	6.27
45	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	868 HK	34,675,102.30	6.10
46	CHINA EAST EDUCATION HOLDING	667 HK	33,657,479.45	5.92
47	Morimatsu International Holdin	2155 HK	32,257,807.06	5.67
48	波司登	03998 HS	32,044,652.91	5.63
49	Remegen Co Ltd	9995 HK	28,460,306.45	5.00
50	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	916 HK	27,948,227.48	4.91
51	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	522 HK	26,618,212.74	4.68
52	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	2869 HK	25,434,906.44	4.47
53	POLY PROPERTY DEVELOPMENT	6049 HK	25,184,545.46	4.43

54	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	1579 HK	24,142,696.44	4.25
55	药明康德	02359 HS	24,028,824.43	4.23
56	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	18,780,302.72	3.30
57	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	VIPS US	18,546,882.92	3.26
58	Aidigong Maternal & Child Heal	286 HK	18,389,098.41	3.23
59	CHINA FEIHE LTD	6186 HK	18,248,237.83	3.21
60	XPENG INC	9868 HK	17,875,574.64	3.14
61	EDVANTAGE GROUP HOLDINGS LTD	382 HK	17,029,029.88	2.99
62	Angelalign Technology Inc	6699 HK	16,349,553.20	2.87
63	LI NING CO LTD	2331 HK	15,843,775.95	2.79
64	TIANGONG INTL CO LTD	826 HK	15,378,148.45	2.70
65	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC.	2018 HK	12,809,867.37	2.25
66	CHINA COSCO HOLDINGS-H	1919 HK	11,504,142.99	2.02

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。

8.5.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	MEITUAN DIANPING	3690 HK	159,278,046.36	28.01
2	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	155,442,399.95	27.33
3	Bilibili Inc	9626 HK	82,776,533.67	14.55
3	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	BILI US	61,313,878.02	10.78
4	WEIMOB INC	2013 HK	136,898,156.89	24.07
5	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	126,770,984.35	22.29
6	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	114,994,328.85	20.22
7	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1308 HK	105,983,169.32	18.64
8	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	104,137,359.91	18.31
9	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	90,604,810.63	15.93
9	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	12,478,784.13	2.19
10	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	100,258,682.64	17.63
11	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	3800 HK	89,227,690.62	15.69
12	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	86,510,525.79	15.21
13	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	86,417,077.50	15.20
14	Haier Smart Home Co Ltd	6690 HK	82,316,581.57	14.47
15	JD.comInc.	9618 HK	78,678,322.21	13.83
16	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3606 HK	78,186,893.02	13.75
17	FUTU HOLDINGS LIMITED	FUTU US	76,171,047.73	13.39
18	MAN WAH HOLDINGS LTD	1999 HK	69,618,808.33	12.24
19	PINDUODUO INC-ADR	PDD US	67,849,623.06	11.93
20	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1 HK	66,377,363.35	11.67
21	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	60,600,861.43	10.66
22	SMOOREINTERNATIONALHOLDING	6969 HK	58,574,335.40	10.30
23	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	316 HK	58,465,676.27	10.28

24	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	968 HK	57,789,834.17	10.16
25	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	57,309,350.91	10.08
26	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	3908 HK	55,992,986.12	9.85
27	CHINA MOBILE LTD	941 HK	53,810,231.78	9.46
28	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	354 HK	50,749,134.37	8.92
29	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	50,646,620.42	8.91
30	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	49,642,649.04	8.73
31	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2689 HK	47,470,124.82	8.35
32	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2330 TT	43,920,847.44	7.72
33	HOPE EDUCATION GROUP CO LTD	1765 HK	42,426,432.73	7.46
34	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	868 HK	41,541,661.48	7.30
35	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	1209 HK	40,109,146.83	7.05
36	Jinke Smart Services Group Co	9666 HK	38,991,767.59	6.86
37	Hangzhou Tigermed Consulting C	3347 HK	37,212,289.48	6.54
38	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	35,061,563.67	6.17
39	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	34,496,893.44	6.07
40	TAL EDUCATION GROUP- ADR	TAL US	34,139,587.16	6.00
41	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	3898 HK	30,960,164.79	5.44
42	CHINA EAST EDUCATION HOLDING	667 HK	28,040,944.64	4.93
43	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	2869 HK	26,285,354.14	4.62
44	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	916 HK	25,903,346.34	4.55
45	NAYUKI HOLDINGS LIMITED	2150 HK	25,844,711.91	4.54
46	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	839 HK	25,301,002.72	4.45
47	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	522 HK	24,564,345.20	4.32
48	TIANGONG INTL CO LTD	826 HK	23,946,247.24	4.21
49	波司登	03998 HS	22,838,466.02	4.02
50	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	1579 HK	20,536,959.53	3.61
51	CHINA FEIHE LTD	6186 HK	19,707,897.18	3.47
52	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	17,912,991.39	3.15
53	Remegen Co Ltd	9995 HK	17,477,177.96	3.07
54	LI NING CO LTD	2331 HK	16,522,523.02	2.91
55	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	VIPS US	16,460,562.40	2.89
56	XPENG INC	9868 HK	15,431,044.35	2.71
57	Angelalign Technology Inc	6699 HK	15,073,242.53	2.65
58	EDVANTAGE GROUP HOLDINGS LTD	382 HK	15,010,320.64	2.64
59	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	14,645,068.36	2.58
60	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC.	2018 HK	14,392,313.87	2.53
61	Aidigong Maternal & Child Heal	286 HK	13,857,416.35	2.44
62	Morimatsu International Holdin	2155 HK	13,772,844.11	2.42
63	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2688 HK	13,531,499.39	2.38
64	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	13,230,746.01	2.33
65	CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	6169 HK	13,133,823.85	2.31
66	CITIC SECURITIES CO LTD-H	6030 HK	12,757,413.29	2.24

67	药明康德	02359 HS	11,724,469.70	2.06
----	------	----------	---------------	------

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。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	4,346,472,024.27
卖出收入（成交）总额	3,581,613,560.78

注：买入股票成本、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。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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、腾讯控股有限公司（以下简称“腾讯控股”，股票代码：00700.HK）于2021年3月12日收到市场监管总局的行政处罚决定书（国市监处〔2021〕13号）。其因价格垄断违反《中华人民共和国反垄断法》相关规定，被处以罚款人民币50万元。

2021年7月6日，腾讯控股因违法实施的经营者集中，但不具有排除、限制竞争的效果，收到市场监管总局的行政处罚决定书（国市监处〔2021〕59号、国市监处〔2021〕61号、国市监处〔2021〕65号），分别被处以罚款人民币50万元，共计150万元。

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腾讯控股进行了投资。

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。

8.11.2 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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	356,378.91
4	应收利息	17,190.98
5	应收申购款	1,954,043.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,327,613.40

8.11.4 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。

8.11.5 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。

8.11.6 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 (%)
137,322	4,347.22	191,182,081.53	32.03	405,786,689.05	67.97

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	689,133.52	0.115439

注：基金管理人的从业人员持有的本基金份额含景顺大中华混合人民币份额及美元现汇份额。

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（2011年9月22日）基金份额总额	291,092,562.55
本报告期期初基金份额总额	239,616,056.07
本报告期基金总申购份额	979,949,921.75
减：本报告期基金总赎回份额	622,597,207.24
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	596,968,770.58

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

1、本管理人于2021年3月30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，聘任刘彦春先生担任本公司副总经理。

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：

1、中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 11 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 80,000.00 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，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Haitong International Securities Company Limited	1	1,484,238,430.35	19.02%	1,257,963.19	17.49%	-
China International Capital Corporation Limited	1	1,427,150,682.13	18.28%	1,287,740.31	17.90%	-
CLSA	1	606,394,850.77	7.77%	842,605.75	11.71%	-
Credit Suisse Hong Kong Limited	1	819,417,321.06	10.50%	819,417.33	11.39%	-
Citigroup Global Markets Asia Limited	1	597,799,931.42	7.66%	629,771.96	8.75%	
海通证券股份有限公司	1	700,506,034.36	8.97%	560,409.04	7.79%	
中国银河证券股份有限公司	1	695,895,019.38	8.92%	556,715.98	7.74%	
中国国际金融股份有限公司	2	388,550,119.60	4.98%	310,840.07	4.32%	
瑞银证券有限责任公司	1	147,945,848.07	1.90%	118,356.19	1.65%	
MASTERLINK	1	73,047,088.99	0.94%	87,656.14	1.22%	
国盛证券有限责任公司	1	112,140,795.55	1.44%	89,711.71	1.25%	

Yuanta securities comp any limited	1	43,920,847.43	0.56%	65,881.28	0.92%	
中信证券股份有限公司	3	91,787,104.88	1.18%	73,430.15	1.02%	
瑞信证券（中国）有限公司	2	89,590,511.84	1.15%	71,672.59	1.00%	
东方财富证券股份有限公司	2	83,901,333.88	1.07%	67,121.64	0.93%	
兴业证券股份有限公司	1	70,637,627.19	0.90%	56,510.66	0.79%	
安信证券股份有限公司	1	64,155,595.51	0.82%	51,324.27	0.71%	
天风证券股份有限公司	1	63,601,902.06	0.81%	50,881.08	0.71%	
招商证券股份有限公司	3	62,854,305.71	0.81%	50,284.39	0.70%	
太平洋证券股份有限公司	1	41,278,064.18	0.53%	33,022.56	0.46%	
华创证券有限责任公司	1	38,943,174.93	0.50%	31,154.61	0.43%	
方正证券股份有限公司	2	38,423,846.00	0.49%	30,738.76	0.43%	
长城证券股份有限公司	1	23,216,084.94	0.30%	18,572.71	0.26%	
平安证券股份有限公司	1	21,638,399.48	0.28%	17,310.55	0.24%	
国海证券股份有限公司	1	18,371,628.15	0.24%	14,697.19	0.20%	
北京高华证券有限责任公司	1	-				
第一创业证券股份有限公司	1	-				
东方证券股份有限公司	3	-				
东亚前海证券有限责任公司	1	-				
广发证券股份有限公司	1	-				
国都证券股份有限公司	1	-				
国金证券股份有限公司	1	-				
国泰君安证券股份有限公司	1	-				
恒泰证券股份有限公司	1	-				
华西证券股份有限公司	1	-				
民生证券股份有限公司	1	-				
申港证券股份有限公司	1	-				
申万宏源证券有限公司	1	-				
中航证券股份有限公司	1	-				
中泰证券股份有限公司	1	-				
中信建投证券股份有限公司	2	-				
中银国际证券股份有限公司	1	-				
ICBC International Hol dings Limited	1	-	-	-	-	-
United Bank of Switze rland	1	-	-	-	-	本期 新增
China Renaissance	1	-	-	-	-	本期 新增
JP Morgan	1					本期 新增
Goldman Sachs	1					本期 新增

注：1、本基金与景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金共用交易单元。

2、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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Haitong International Securities Company Limited							-	-
China International Capital Corporation Limited							-	-
Credit Suisse Hong Kong Limited							-	-
海通证券股份有限公司							-	-
中国银河证券股份有限公司							-	-
CLSA							-	-
Citigroup Global Markets Asia Limited							-	-
中国国际金融股份有限公司							-	-
瑞银证券有限责任公司							-	-
国盛证券有限责任公司							-	-

中信证券股份有限公司								-	-
瑞信证券（中国）有限公司								-	-
东方财富证券股份有限公司								-	-
MASTERLINK								-	-
兴业证券股份有限公司								-	-
安信证券股份有限公司								-	-
天风证券股份有限公司								-	-
招商证券股份有限公司								-	-
Yuanta securities company limited								-	-
太平洋证券股份有限公司								-	-
华创证券有限责任公司								-	-
方正证券股份有限公司								-	-
长城证券股份有限公司								-	-
平安证券股份有限公司								-	-
国海证券股份有限公司								-	-
北京高华证券有限责任公司								-	-
第一创业证券股份有限公司								-	-
东方证券股份有限公司								-	-
东亚前海证券有限责任公司								-	-
广发证券股份有限公司								-	-
国都证券股份有限公司								-	-
国金证券股份有限公司								-	-
国泰君安证券股份有限公司								-	-
恒泰证券股份有限公司								-	-
华西证券股份有限公司								-	-
民生证券股份有限公司								-	-
申港证券股份有限公司								-	-
申万宏源证券有限公司								-	-
中航证券股份有限公司								-	-
中泰证券股份有限公司								-	-
中信建投证券股份有限公司								-	-
中银国际证券股份有限公司								-	-
ICBC International Holdings Limited								-	-
United Bank of Switzerland								-	-
China Renaissance								-	-
JP Morgan								-	-

Goldman Sachs									
---------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--

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系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-08
2	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	2021-01-15
3	关于景顺长城大中华混合型证券投资基金 2021 年境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）和赎回业务安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加财通证券股份有限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	2021-01-15
5	景顺长城基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统招行直联渠道基金交易费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-20
6	景顺长城大中华混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
8	关于景顺长城大中华混合型证券投资基金人民币基金份额在广发证券开通基金定期定额投资业务及参加定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-26
9	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-04
10	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	2021-02-05
11	景顺长城基金管理有限公司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	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-09
12	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	2021-02-25
13	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-25
14	关于旗下部分基金新增中欧财富为销售机构并开通基金“定期定额投资业	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-09

	务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告		
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加安信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	2021-03-15
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国国际金融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	2021-03-19
18	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	2021-03-20
19	关于旗下部分基金新增阳光人寿保险股份有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-25
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-26
21	景顺长城大中华混合型证券投资基金2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
23	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	2021-03-30
24	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-31
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
26	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	2021-04-12
27	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	2021-04-15
28	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	2021-04-19
29	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-20
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
31	景顺长城大中华混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22

32	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-23
33	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-27
34	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	2021-05-12
35	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-17
36	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增青岛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	2021-05-19
37	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	2021-05-20
38	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-04
39	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	2021-06-15
40	景顺长城大中华混合型证券投资基金托管协议更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
41	景顺长城大中华混合型证券投资基金2021年第1号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
42	景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
43	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	2021-06-18
44	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-29
45	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-09
46	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	2021-07-13
47	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-16
48	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-20
49	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报刊及	2021-07-21

	基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	网站	
50	景顺长城大中华混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-21
51	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	2021-07-23
52	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-27
53	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-06
54	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增晋商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	2021-08-11
55	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-20
56	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-23
57	景顺长城大中华混合型证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-23
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	2021-08-27
59	景顺长城基金将积极参与投资北京证券交易所上市企业	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-07
60	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-14
61	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-30
62	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-12
63	景顺长城大中华混合型证券投资基金暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-13
64	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	2021-10-15
65	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	2021-10-15
66	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	2021-10-22

67	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-27
68	景顺长城大中华混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-27
69	景顺长城基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金投资北交所上市股票的风险提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-16
70	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	2021-11-18
71	关于旗下部分基金参加国信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	2021-11-26
72	景顺长城大中华混合型证券投资基金 2021 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-30
73	景顺长城大中华混合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	2021-11-30
74	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	2021-12-03
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	2021-12-10
76	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在珠海盈米基金销售有限公司开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-16
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	2021-12-17
78	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-22
79	关于旗下部分基金新增泰信财富为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-24
80	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	2021-12-24
81	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-29
82	景顺长城基金管理有限公司关于暂停北京钱景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	2021-12-29

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210101-20210120	72,000,000.00	-	-	72,000,000.00	12.06

产品特有风险

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

1、大额申购风险

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

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

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

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

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

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

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

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

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

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运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规及本基金基金合同等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，景顺长城

基金管理有限公司决定对本基金的基金合同等法律文件进行修订，新增侧袋机制相关内容。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 2021 年 6 月 18 日起正式生效。有关详细信息参见本公司于 2021 年 6 月 18 日发布的相关公告。

§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大中华股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城大中华混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城大中华混合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

2022 年 3 月 28 日