

# 景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 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，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 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>5</b>
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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	21

<b>§8 投资组合报告</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	59
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	59
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12 市场中性策略执行情况	60
8.13 投资组合报告附注	60
<b>§9 基金份额持有人信息</b>	<b>62</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
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	62
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况	62
<b>§10 开放式基金份额变动</b>	<b>62</b>
<b>§11 重大事件揭示</b>	<b>63</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	68
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>74</b>
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	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
<b>§13 备查文件目录</b>	<b>75</b>
13.1 备查文件目录	75
13.2 存放地点	75
13.3 查阅方式	75

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合
基金主代码	008851
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年2月27日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,153,475,954.87份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型和绝对收益策略，有效对冲市场系统性风险，追求长期稳定的绝对收益。
投资策略	<p>本基金主要采用量化对冲的投资策略，一方面坚持采用基金管理人自主研发的量化模型构建股票投资组合，另一方面，灵活应用多种绝对收益策略有效对冲本基金的系统性风险，例如做空股指期货进行对冲操作，获取选股的超额收益，追求长期稳定的绝对收益。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金采用灵活配置的投资策略，根据基金所使用对冲工具的年化对冲成本来决定当月股票资产的投资比例，建仓期（6个月）内不受仓位调整机制的约束，建仓期满的第一个月起（包括第一个月），如基金所使用对冲工具的年化对冲成本达到仓位调整阈值，则触发仓位调整机制。</p> <p>2、对冲策略</p> <p>本基金现阶段主要通过股指期货有效对冲持有股票的系统性风险。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理和风险控制的原则，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金通过对现货和期货市场相关性研究，计算需要的股指期货合约数量，并根据不同期货合约定价关系、保证金要求、流动性情况等因素，对股指期货合约数量及配比进行动态调整，寻求与现货资产的匹配，力争构建市场中性投资组合并获得稳定的正向超额收益。</p> <p>3、套利策略</p> <p>本基金寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉套利和绝对收益机会，以提高资本的利用率，从而达到投资策略的多元化，努力进一步提高绝对收益水平，例如股指期货套利、统计套利、定向增发套利、大宗交易套利、并购套利等。</p>
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期1年定期存款基准利率（税后）+1%。
风险收益特征	本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决

于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	郭明
	联系电话	0755-82370388	(010) 66105799
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755-22381339	(010) 66105798
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		李进	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	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 2 月 27 日 (基金合同生效日) -2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	37,216,906.09	24,855,104.34
本期利润	8,231,269.23	54,173,552.78
加权平均基金份额本期利润	0.0061	0.0246
本期加权平均净值利润率	0.58%	2.43%
本期基金份额净值增长率	1.57%	1.45%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	16,662,625.21	-20,532,293.44
期末可供分配基金份额利润	0.0144	-0.0164
期末基金资产净值	1,188,569,174.62	1,267,925,724.19
期末基金份额净值	1.0304	1.0145

3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	3.04%	1.45%

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四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

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

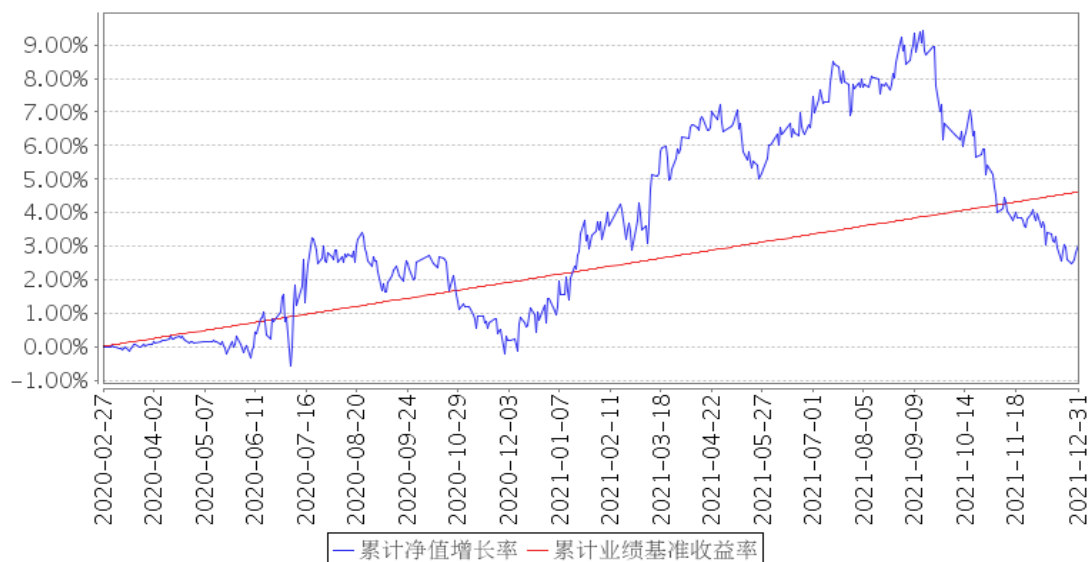
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.40%	0.27%	0.61%	0.01%	-4.01%	0.26%
过去六个月	-3.62%	0.32%	1.22%	0.01%	-4.84%	0.31%
过去一年	1.57%	0.33%	2.45%	0.01%	-0.88%	0.32%
自基金合同生效起至今	3.04%	0.32%	4.61%	0.01%	-1.57%	0.31%

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

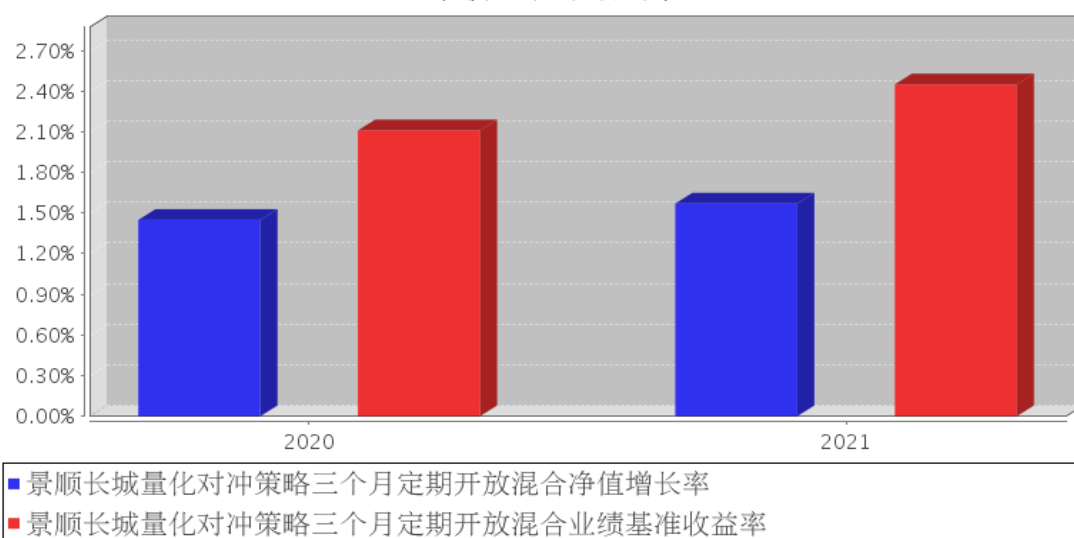
景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：本基金权益类多头头寸的价值减去本基金权益类空头头寸的价值占基金资产净值的 0-10%之间。本基金投资于同业存单和银行存款的合计占比不超过基金资产的 20%。在开放期的每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。在开放期，每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。本基金的建仓期为自 2020 年 2 月 27 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合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



注：2020 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间为 2020 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2020 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至本报告期末未进行利润分配。



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“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		
黎海威	本基金的基金经理	2020年2月27日	-	18年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪KMV公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，自2013年10月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有18年海内外证券、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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金持有人谋求最大利益。本报告期内, 基金运作整体合法合规, 未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，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。

##### 4.3.3 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。

## 4.4 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

2021 年，受出口超预期增长、新动能不断增强和上半年低基数等因素的影响，中国经济稳定回升，全年呈现前高后低走势。全年 GDP 增长 8.1%，工业增加值累计增长 9.6%。12 月 PMI 指数 50.3，景气指数企稳回升。12 月 PPI 同比上涨 10.3%，环比下降 2.6%；12 月 CPI 同比上涨 1.5%，环比下降 0.8%。12 月 M2 同比增速 9%，M1 同比增速 3.5%，全年社会融资规模存量同比增长 10.29%。12 月末外汇储备 3.25 万亿美元，汇率保持基本稳定。

2021 年上半年，超预期强势的出口和极具韧性的房地产投资对经济形成有力支撑。下半年以来，出口以及房地产投资的情况均出现了明显变化，经济面临一定的下行压力。受疫情持续反复及居民收入增长乏力等因素影响，国内消费疲弱，12 月社会消费品零售总额同比增长 1.7%，增速尚未恢复到疫情前水平。信用环境仍偏弱，政策层面宽信用的意图比较明确，货币政策方面也通过全面降准、多种结构性工具进行配合。2021 年全年 A 股市场呈现出结构性分化行情，沪深 300 指数下跌 5.2%，中证 500 和创业板指分别上涨 15.58%、12.02%。

### 4.4.2 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 1.57%，业绩比较基准收益率为 2.45%。

## 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 2022 年，海外流动性拐点临近、通胀压力仍在，外需大概率将走弱，需要警惕美股波动以及美元走高对于新兴市场的冲击。国内经济可能要面临内外需同时走弱风险，经济扩张动能减弱的趋势或将维持。PPI-CPI 的剪刀差将明显收窄，中下游盈利能力有望得到边际修复。为了稳定增长，货币、信用进入新一轮宽松周期，但预计整体扩张力度较温和，信用分化、结构性扩张的格局将延续。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。权益市场仍具备结构性配置机会，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。股指期货方面，随着市场情绪改善，股指期货贴水逐步改善，当基差收敛到合理范围内，我们将继续择机提升对冲仓位水平。展望未来，我们预计市场将持续保持热度，并且热点逐步开始轮换，这样的市场环境非常适合量化模型的表现，同时我们要警惕海外风险以及政策收紧带来的市场风险。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

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

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

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

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

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

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断

提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截至本报告期末，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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，在本报告期内未触及《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

## §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 24484 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	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金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量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“景顺长城量化对冲策略三个月定开基金”)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量化对冲策略三个月定期开基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营</p>

	成果和基金净值变动情况。
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量化对冲策略三个月定期基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>景顺长城量化对冲策略三个月定期基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估景顺长城量化对冲策略三个月定期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量化对冲策略三个月定期基金、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量化对冲策略三个月定期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，就可能对景顺长城量化对冲策略三个月定期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</p>



	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量化对冲策略三个月定开基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	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：景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	57,025,115.00	32,767,170.77
结算备付金		116,063,991.57	85,785,429.67
存出保证金		105,818,708.47	100,663,866.48
交易性金融资产	7.4.7.2	911,684,344.11	959,775,061.89
其中：股票投资		911,418,344.11	959,701,061.89
基金投资		-	-
债券投资		266,000.00	74,000.00
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	-	90,000,000.00
应收证券清算款		90,819.57	789,076.10
应收利息	7.4.7.5	63,309.29	242,625.69
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,190,746,288.01	1,270,023,230.60
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,516,521.61	1,598,009.01
应付托管费		202,202.88	213,067.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	238,388.64	186,429.36
应交税费		0.26	0.17
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	220,000.00	100,000.00
负债合计		2,177,113.39	2,097,506.41
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,153,475,954.87	1,249,696,567.30
未分配利润	7.4.7.10	35,093,219.75	18,229,156.89
所有者权益合计		1,188,569,174.62	1,267,925,724.19
负债和所有者权益总计		1,190,746,288.01	1,270,023,230.60

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0304 元，基金份额总额 1,153,475,954.87 份。

## 7.2 利润表

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

本报告期：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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 27 日（基金合同 生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		40,056,816.04	93,625,888.55
1. 利息收入		2,941,984.15	13,487,976.16
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,899,443.28	13,303,925.69
债券利息收入		4,794.30	597.05
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		37,746.57	183,453.42
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		64,128,718.12	45,438,814.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	155,258,019.57	408,862,283.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	605,063.94	880,191.99
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-111,775,272.00	-398,745,311.36
股利收益	7.4.7.15	20,040,906.61	34,441,650.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-28,985,636.86	29,318,448.44
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,971,750.63	5,380,649.50
减：二、费用		31,825,546.81	39,452,335.77
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	21,305,410.69	28,138,322.99
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,840,721.42	3,751,776.37
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	7,459,006.06	7,323,165.66
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.64	138,345.75
7. 其他费用	7.4.7.19	220,408.00	100,725.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,231,269.23	54,173,552.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,231,269.23	54,173,552.78

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

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

本报告期：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）	1,249,696,567.30	18,229,156.89	1,267,925,724.19
二、本期经营活动产生的	-	8,231,269.23	8,231,269.23

基金净值变动数（本期利润）			
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）	-96,220,612.43	8,632,793.63	-87,587,818.80
其中：1. 基金申购款	1,200,620,167.40	79,888,696.84	1,280,508,864.24
2. 基金赎回款	-1,296,840,779.83	-71,255,903.21	-1,368,096,683.04
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）	1,153,475,954.87	35,093,219.75	1,188,569,174.62
项目	上年度可比期间 2020年2月27日（基金合同生效日）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）	2,803,947,219.94	-	2,803,947,219.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	54,173,552.78	54,173,552.78
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）	-1,554,250,652.64	-35,944,395.89	-1,590,195,048.53
其中：1. 基金申购款	576,374,759.07	8,712,644.73	585,087,403.80
2. 基金赎回款	-2,130,625,411.71	-44,657,040.62	-2,175,282,452.33
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）	1,249,696,567.30	18,229,156.89	1,267,925,724.19

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

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2891号《关于准予景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,803,173,163.28 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0106 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 2 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,803,947,219.94 份基金份额,其中认购资金利息折合 774,056.66 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票及存托凭证)、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资融券业务交易。本基金的投资组合比例为:本基金权益类多头头寸的价值减去本基金权益类空头头寸的价值占基金资产净值的 0-10%之间。其中:权益类多头头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。权益类空头头寸价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值。本基金投资于同业存单和银行存款的合计占比不超过基金资产的 20%。开放期内每个交易日日终,本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%,封闭

期内每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。开放期每个交易日日终，在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。在封闭期内，本基金不受前述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期 1 年定期存款基准利率（税后）+1%。

本基金以定期开放的方式运作。本基金每三个月开放一次，每次开放期不超过 5 个工作日，每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份在后续每三个日历月中最后一个日历月，每个开放期的首日为当月沪深 300 股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购、赎回与转换业务，且不上市交易。

本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。比较财务报表的实际编制期间为 2020 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

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

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

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

#### (2) 金融负债的分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认



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

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

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

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

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

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

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

对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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

对基金通过沪港通或深港通(如有)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(如有)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) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通(如有)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	57,025,115.00	32,767,170.77
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	57,025,115.00	32,767,170.77

### 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	913,640,092.53	911,418,344.11	-2,221,748.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	266,000.00	266,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	266,000.00	266,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	913,906,092.53	911,684,344.11	-2,221,748.42
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	855,814,481.45	959,701,061.89	103,886,580.44
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	74,000.00	74,000.00
	银行间市场	-	-

	合计	74,000.00	74,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	855,888,481.45	959,775,061.89	103,886,580.44

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-870,663,960.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-870,663,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-870,663,960.00	-	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-760,330,188.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-760,330,188.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-760,330,188.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2201	中证500期货2201合约	-25	-36,889,000.00	-807,920.00
IC2203	中证500期货2203合约	-20	-29,223,200.00	-352,360.00
IF2203	沪深300期货2203合约	-540	-801,997,200.00	3,714,840.00
减：可抵销期货暂收款				2,554,560.00
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	90,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	90,000,000.00	-

##### 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	5,345.56	2,850.11
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	57,808.33	56,106.66
应收债券利息	9.90	1.30
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	183,453.42
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	145.50	214.20
合计	63,309.29	242,625.69

#### 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	上年度末
----	-----	------

	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	238,388.64	186,429.36
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	238,388.64	186,429.36

#### 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	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	220,000.00	100,000.00
合计	220,000.00	100,000.00

#### 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	1,249,696,567.30	1,249,696,567.30
本期申购	1,200,620,167.40	1,200,620,167.40
本期赎回（以“-”号填列）	-1,296,840,779.83	-1,296,840,779.83
- 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	1,153,475,954.87	1,153,475,954.87

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	-20,532,293.44	38,761,450.33	18,229,156.89
本期利润	37,216,906.09	-28,985,636.86	8,231,269.23
本期基金份额交易产生的变动数	-21,987.44	8,654,781.07	8,632,793.63
其中：基金申购款	39,798,750.04	40,089,946.80	79,888,696.84
基金赎回款	-39,820,737.48	-31,435,165.73	-71,255,903.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,662,625.21	18,430,594.54	35,093,219.75

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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2月27日(基金合同生效日)
----	-----------------------------	--------------------------------

		至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	372,811.74	1,799,174.28
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	2,521,750.99	11,497,987.01
其他	4,880.55	6,764.40
合计	2,899,443.28	13,303,925.69

#### 7.4.7.12 股票投资收益

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2月27日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
卖出股票成交总额	5,296,152,638.26	5,105,454,374.34
减：卖出股票成本总额	5,140,894,618.69	4,696,592,091.14
买卖股票差价收入	155,258,019.57	408,862,283.20

#### 7.4.7.13 债券投资收益

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2月27日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	6,099,654.96	4,735,805.71
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	5,489,800.00	3,855,000.00
减：应收利息总额	4,791.02	613.72
买卖债券差价收入	605,063.94	880,191.99

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

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2月27日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
股指期货投资收益	-111,775,272.00	-398,745,311.36

#### 7.4.7.15 股利收益

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2月27日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	20,040,906.61	34,441,650.62
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	20,040,906.61	34,441,650.62

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年2月27日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-106,108,328.86	103,886,580.44
股票投资	-106,108,328.86	103,886,580.44
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	77,122,692.00	-74,568,132.00
权证投资	-	-
期货	77,122,692.00	-74,568,132.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-28,985,636.86	29,318,448.44

#### 7.4.7.17 其他收入

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2月27日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	1,966,583.22	5,356,778.42
基金转换费收入	5,167.41	23,871.08
合计	1,971,750.63	5,380,649.50

#### 7.4.7.18 交易费用

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2月27日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	7,459,006.06	7,323,165.66
银行间市场交易费用	-	-
合计	7,459,006.06	7,323,165.66

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月	上年度可比期间 2020年2月27日（基金合同生效日）
----	--------------------------	--------------------------------

	31 日	至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	408.00	325.00
其他	-	400.00
合计	220,408.00	100,725.00

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司(“长城证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	21,305,410.69	28,138,322.99
其中：支付销售机构的客户维护费	2,158,155.83	10,714,193.54

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,840,721.42	3,751,776.37

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

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

#### 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

本基金于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

本基金于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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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 2 月 27 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2020 年 2 月 27 日)持有的基金份额	10,001,000.10	10,001,000.10
报告期初持有的基金份额	10,001,000.10	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,000.10	10,001,000.10
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.87%	0.80%

#### 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		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		2020 年 2 月 27 日(基金合同生效日)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
中国工商银行-活期	57,025,115.00	372,811.74	32,767,170.77	1,799,174.28

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 7.4.12 期末(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

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票
----------------------

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股流通受限	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股流通受限	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股流通受限	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301045	天禄科技	2021年8月6日	2022年2月17日	新股流通受限	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-

301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新股流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股流通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301066	万事利	2021年9月13日	2022年3月22日	新股流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301082	久盛电气	2021年10月14日	2022年4月27日	新股流通受限	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股流通受限	93.09	75.34	848	78,940.32	63,888.32	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新股流通受限	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股流通受限	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301098	金埔园林	2021年11月	2022年5月	新股流	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-

		4 日	12 日	通受限							
301099	雅创电子	2021 年 11 月 10 日	2022 年 5 月 23 日	新股流 通受限	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-	
301100	风光股份	2021 年 12 月 10 日	2022 年 6 月 17 日	新股流 通受限	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-	
301101	明月镜片	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 月 16 日	新股流 通受限	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-	
301108	洁雅股份	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 6 日	新股流 通受限	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-	
301111	粤万年青	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股流 通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-	
301118	恒光股份	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 18 日	新股流 通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-	
301126	达嘉维康	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股流 通受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-	
301127	天源环保	2021 年 12 月 23 日	2022 年 6 月 30 日	新股流 通受限	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-	
301133	金钟股份	2021 年 11 月 19 日	2022 年 5 月 26 日	新股流 通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-	
301138	华研精机	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新股流 通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-	
301149	隆华新材	2021 年 11 月 3 日	2022 年 5 月 10 日	新股流 通受限	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-	
301155	海力风电	2021 年 11 月 17 日	2022 年 5 月 24 日	新股流 通受限	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-	
301166	优宁维	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	新股流 通受限	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-	
301168	通灵股份	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 10 日	新股流 通受限	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-	
301177	迪阿股份	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新股流 通受限	116.88	116.08	608	71,063.04	70,576.64	-	
301179	泽宇智能	2021 年 12 月 1 日	2022 年 6 月 8 日	新股流 通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-	
301182	凯旺科技	2021 年 12 月 16 日	2022 年 6 月 23 日	新股流 通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-	
301185	鸥玛软件	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 19 日	新股流 通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-	
301188	力诺特玻	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 11 日	新股流 通受限	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-	
301189	奥尼电子	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	新股流 通受限	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-	
301190	善水科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新股流 通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-	

301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股流通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	新股流通受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股流通受限	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
688038	中科通达	2021年7月5日	2022年1月13日	新股流通受限	8.60	18.72	2,132	18,335.20	39,911.04	-
688071	华依科技	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	13.73	62.31	1,101	15,116.73	68,603.31	-
688190	云路股份	2021年11月18日	2022年5月26日	新股流通受限	46.63	92.51	3,026	141,102.38	279,935.26	-
688210	统联精密	2021年12月20日	2022年6月27日	新股流通受限	42.76	39.53	2,218	94,841.68	87,677.54	-
688232	新点软件	2021年11月10日	2022年5月17日	新股流通受限	48.49	41.99	18,893	916,121.57	793,317.07	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股流通受限	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688701	卓锦股份	2021年9月8日	2022年3月16日	新股流通受限	7.48	13.50	2,340	17,503.20	31,590.00	-
688786	悦安新材	2021年8月18日	2022年2月28日	新股流通受限	11.76	54.01	1,513	17,792.88	81,717.13	-
871245	威博液压	2021年12月24日	2022年1月6日	新股流通受限	9.68	9.68	200	1,936.00	1,936.00	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021年12月28日	2022年1月14日	新债流通受限	100.00	100.00	2,360	236,000.00	236,000.00	-
113634	珀莱转债	2021年12月9日	2022年1月4日	新债流通受限	100.00	100.00	300	30,000.00	30,000.00	-

注：上述流通受限证券的“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终可流通日期以上市公司公告为准。

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。



### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 7.4.13.2 信用风险

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

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

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不

超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.02%（上年度末：0.01%）。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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	57,025,115.00	-	-	-	-	-	57,025,115.00
结算备付金	116,063,991.57	-	-	-	-	-	116,063,991.57
存出保证金	323,336.47	-	-	-	-	105,495,372.00	105,818,708.47
交易性金融资产	-	-	-	-	266,000.00	911,418,344.11	911,684,344.11
应收利息	-	-	-	-	-	63,309.29	63,309.29
应收证券清算款	-	-	-	-	-	90,819.57	90,819.57

资产总计	173,412,443.04	-	-	-	-266,000.00	1,017,067,844.97	1,190,746,288.01
负债							
应付管理人报酬						1,516,521.61	1,516,521.61
应付托管费						202,202.88	202,202.88
应付交易费用						238,388.64	238,388.64
应交税费						0.26	0.26
其他负债						220,000.00	220,000.00
负债总计						2,177,113.39	2,177,113.39
利率敏感度缺口	173,412,443.04				-266,000.00		
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	32,767,170.77						32,767,170.77
结算备付金	85,785,429.67						85,785,429.67
存出保证金	476,068.08					100,187,798.40	100,663,866.48
交易性金融资产					74,000.00	959,701,061.89	959,775,061.89
买入返售金融资产	90,000,000.00						90,000,000.00
应收利息						242,625.69	242,625.69
应收证券清算款						789,076.10	789,076.10
资产总计	209,028,668.52				74,000.00	1,060,920,562.08	1,270,023,230.60
负债							
应付管理人报酬						1,598,009.01	1,598,009.01
应付托管费						213,067.87	213,067.87
应付交易费用						186,429.36	186,429.36
应交税费						0.17	0.17
其他负债						100,000.00	100,000.00
负债总计						2,097,506.41	2,097,506.41
利率敏感度缺口	209,028,668.52				74,000.00		

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.02%（上年末：0.01%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最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	911,418,344.11	76.68	959,701,061.89	75.69
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	911,418,344.11	76.68	959,701,061.89	75.69

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注：7.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

##### 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%	3,071,602.76	11,078,287.91
	沪深300指数下降5%	-3,071,602.76	-11,078,287.91

#### 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 908,618,659.17 元，属于第二层次的余额为 3,065,684.94 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 918,508,902.85 元，第二层次 41,266,159.04 元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 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》,公募基金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	911,418,344.11	76.54
	其中:股票	911,418,344.11	76.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	266,000.00	0.02
	其中:债券	266,000.00	0.02
	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	173,089,106.57	14.54
8	其他各项资产	105,972,837.33	8.90
9	合计	1,190,746,288.01	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	693,680.00	0.06
B	采矿业	24,033,020.70	2.02
C	制造业	547,536,526.93	46.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,190,706.00	1.61

E	建筑业	24,711,324.99	2.08
F	批发和零售业	3,491,776.44	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	22,786,182.00	1.92
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,409,879.28	2.31
J	金融业	171,110,925.51	14.40
K	房地产业	14,522,821.00	1.22
L	租赁和商务服务业	17,638,420.49	1.48
M	科学研究和技术服务业	18,666,905.66	1.57
N	水利、环境和公共设施管理业	1,302,777.91	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,026,048.89	1.01
R	文化、体育和娱乐业	6,292,740.31	0.53
S	综合	-	-
	合计	911,418,344.11	76.68

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	21,811	44,712,550.00	3.76
2	300750	宁德时代	56,213	33,053,244.00	2.78
3	600030	中信证券	1,000,927	26,434,482.07	2.22
4	600887	伊利股份	614,500	25,477,170.00	2.14
5	600036	招商银行	502,963	24,499,327.73	2.06
6	601318	中国平安	440,440	22,202,580.40	1.87
7	300059	东方财富	519,254	19,269,515.94	1.62
8	601012	隆基股份	182,638	15,743,395.60	1.32
9	000333	美的集团	200,100	14,769,381.00	1.24
10	600309	万华化学	139,147	14,053,847.00	1.18
11	601668	中国建筑	2,790,300	13,951,500.00	1.17
12	002415	海康威视	240,200	12,567,264.00	1.06
13	600919	江苏银行	1,793,679	10,457,148.57	0.88
14	000858	五粮液	45,800	10,197,828.00	0.86
15	601899	紫金矿业	1,001,700	9,716,490.00	0.82
16	600809	山西汾酒	30,301	9,568,449.78	0.81
17	000063	中兴通讯	279,300	9,356,550.00	0.79



18	601009	南京银行	1,002,100	8,978,816.00	0.76
19	002594	比亚迪	33,156	8,889,786.72	0.75
20	000725	京东方 A	1,752,600	8,850,630.00	0.74
21	002129	中环股份	211,066	8,812,005.50	0.74
22	601939	建设银行	1,424,800	8,349,328.00	0.70
23	603986	兆易创新	46,147	8,114,949.95	0.68
24	300760	迈瑞医疗	20,900	7,958,720.00	0.67
25	603259	药明康德	66,796	7,920,669.68	0.67
26	600502	安徽建工	1,862,500	7,729,375.00	0.65
27	002410	广联达	118,525	7,583,229.50	0.64
28	002142	宁波银行	192,071	7,352,477.88	0.62
29	002241	歌尔股份	135,704	7,341,586.40	0.62
30	600183	生益科技	310,700	7,316,985.00	0.62
31	002839	张家港行	1,267,600	7,301,376.00	0.61
32	601919	中远海控	387,400	7,240,506.00	0.61
33	300122	智飞生物	57,611	7,178,330.60	0.60
34	600438	通威股份	156,900	7,054,224.00	0.59
35	002460	赣锋锂业	49,000	6,999,650.00	0.59
36	600885	宏发股份	92,900	6,934,056.00	0.58
37	000988	华工科技	247,600	6,898,136.00	0.58
38	601888	中国中免	31,264	6,859,634.24	0.58
39	600436	片仔癀	15,500	6,775,825.00	0.57
40	300124	汇川技术	94,454	6,479,544.40	0.55
41	600282	南钢股份	1,714,100	6,342,170.00	0.53
42	000100	TCL 科技	1,016,100	6,269,337.00	0.53
43	601225	陕西煤业	512,097	6,247,583.40	0.53
44	002475	立讯精密	123,500	6,076,200.00	0.51
45	601166	兴业银行	315,200	6,001,408.00	0.50
46	600900	长江电力	264,300	5,999,610.00	0.50
47	300347	泰格医药	46,500	5,942,700.00	0.50
48	603882	金域医学	52,999	5,902,498.63	0.50
49	600176	中国巨石	321,061	5,843,310.20	0.49
50	601598	中国外运	1,290,305	5,780,566.40	0.49
51	600008	首创环保	1,660,600	5,662,646.00	0.48
52	000039	中集集团	329,200	5,649,072.00	0.48
53	002049	紫光国微	24,700	5,557,500.00	0.47
54	300274	阳光电源	38,000	5,540,400.00	0.47
55	002709	天赐材料	47,900	5,491,735.00	0.46
56	600570	恒生电子	86,940	5,403,321.00	0.45
57	002648	卫星化学	134,500	5,384,035.00	0.45
58	000661	长春高新	19,612	5,322,696.80	0.45
59	000568	泸州老窖	20,900	5,305,883.00	0.45

60	603501	韦尔股份	16,400	5,096,628.00	0.43
61	600373	中文传媒	402,300	4,972,428.00	0.42
62	000002	万科 A	248,800	4,916,288.00	0.41
63	600057	厦门象屿	578,725	4,913,375.25	0.41
64	601658	邮储银行	960,400	4,898,040.00	0.41
65	600690	海尔智家	163,800	4,895,982.00	0.41
66	300014	亿纬锂能	41,400	4,892,652.00	0.41
67	300244	迪安诊断	145,200	4,874,364.00	0.41
68	601328	交通银行	1,055,800	4,867,238.00	0.41
69	300759	康龙化成	33,500	4,732,545.00	0.40
70	600132	重庆啤酒	30,200	4,569,864.00	0.38
71	002371	北方华创	12,800	4,441,856.00	0.37
72	300450	先导智能	58,060	4,317,922.20	0.36
73	600584	长电科技	134,700	4,178,394.00	0.35
74	600048	保利发展	262,500	4,102,875.00	0.35
75	600029	南方航空	594,900	4,051,269.00	0.34
76	603799	华友钴业	36,500	4,026,315.00	0.34
77	300037	新宙邦	34,800	3,932,400.00	0.33
78	300316	晶盛机电	54,930	3,817,635.00	0.32
79	002821	凯莱英	8,700	3,784,500.00	0.32
80	601699	潞安环能	332,330	3,758,652.30	0.32
81	000932	华菱钢铁	732,200	3,741,542.00	0.31
82	600111	北方稀土	79,700	3,650,260.00	0.31
83	002230	科大讯飞	69,100	3,628,441.00	0.31
84	600741	华域汽车	128,100	3,625,230.00	0.31
85	600104	上汽集团	170,848	3,524,594.24	0.30
86	600808	马钢股份	954,100	3,520,629.00	0.30
87	601666	平煤股份	413,900	3,464,343.00	0.29
88	002812	恩捷股份	13,100	3,280,240.00	0.28
89	601881	中国银河	284,016	3,178,139.04	0.27
90	000507	珠海港	490,800	3,170,568.00	0.27
91	601818	光大银行	952,900	3,163,628.00	0.27
92	600779	水井坊	25,606	3,072,463.94	0.26
93	600908	无锡银行	538,300	3,052,161.00	0.26
94	300723	一品红	84,200	3,022,780.00	0.25
95	000498	山东路桥	488,500	3,018,930.00	0.25
96	601615	明阳智能	113,300	2,957,130.00	0.25
97	601288	农业银行	986,300	2,899,722.00	0.24
98	002156	通富微电	142,900	2,776,547.00	0.23
99	300573	兴齐眼药	18,800	2,571,840.00	0.22
100	688030	山石网科	86,595	2,568,407.70	0.22
101	000060	中金岭南	511,500	2,511,465.00	0.21

102	601878	浙商证券	185,300	2,442,254.00	0.21
103	600415	小商品城	475,100	2,304,235.00	0.19
104	603599	广信股份	58,900	2,297,100.00	0.19
105	600325	华发股份	375,400	2,259,908.00	0.19
106	300253	卫宁健康	133,100	2,230,756.00	0.19
107	002223	鱼跃医疗	57,800	2,184,840.00	0.18
108	603456	九洲药业	38,806	2,183,225.56	0.18
109	601633	长城汽车	44,900	2,179,446.00	0.18
110	002236	大华股份	92,100	2,162,508.00	0.18
111	601128	常熟银行	324,500	2,144,945.00	0.18
112	600529	山东药玻	48,600	2,133,540.00	0.18
113	603659	璞泰来	13,200	2,120,052.00	0.18
114	601877	正泰电器	39,300	2,117,877.00	0.18
115	688235	百济神州	14,653	2,117,505.03	0.18
116	000625	长安汽车	139,340	2,116,574.60	0.18
117	601688	华泰证券	118,500	2,104,560.00	0.18
118	000825	太钢不锈	298,100	2,098,624.00	0.18
119	600803	新奥股份	114,300	2,098,548.00	0.18
120	000651	格力电器	55,600	2,058,868.00	0.17
121	600662	外服控股	280,985	2,011,852.60	0.17
122	002064	华峰化学	189,900	1,982,556.00	0.17
123	600546	山煤国际	240,500	1,974,505.00	0.17
124	600116	三峡水利	167,700	1,955,382.00	0.16
125	688200	华峰测控	3,728	1,908,363.20	0.16
126	000938	紫光股份	81,700	1,866,845.00	0.16
127	000913	钱江摩托	129,600	1,839,024.00	0.15
128	600426	华鲁恒升	58,588	1,833,804.40	0.15
129	603806	福斯特	13,900	1,814,645.00	0.15
130	300662	科锐国际	28,900	1,797,869.00	0.15
131	603260	合盛硅业	13,600	1,794,792.00	0.15
132	601158	重庆水务	275,900	1,768,519.00	0.15
133	002027	分众传媒	215,300	1,763,307.00	0.15
134	601882	海天精工	68,300	1,691,791.00	0.14
135	002202	金风科技	100,900	1,661,823.00	0.14
136	300358	楚天科技	63,300	1,650,231.00	0.14
137	002008	大族激光	30,200	1,630,800.00	0.14
138	300896	爱美客	3,000	1,608,330.00	0.14
139	688122	西部超导	16,500	1,599,510.00	0.13
140	002330	得利斯	235,800	1,549,206.00	0.13
141	001979	招商蛇口	115,900	1,546,106.00	0.13
142	300395	菲利华	23,300	1,531,742.00	0.13
143	002555	三七互娱	54,500	1,472,590.00	0.12

144	002533	金杯电工	170,000	1,463,700.00	0.12
145	601138	工业富联	120,619	1,437,778.48	0.12
146	000933	神火股份	156,000	1,418,040.00	0.12
147	000960	锡业股份	72,600	1,417,878.00	0.12
148	000906	浙商中拓	123,100	1,367,641.00	0.12
149	300327	中颖电子	19,500	1,324,050.00	0.11
150	601689	拓普集团	24,400	1,293,200.00	0.11
151	600765	中航重机	25,500	1,287,495.00	0.11
152	600136	当代文体	191,400	1,282,380.00	0.11
153	002179	中航光电	12,600	1,267,056.00	0.11
154	002271	东方雨虹	23,800	1,253,784.00	0.11
155	600760	中航沈飞	18,391	1,251,323.64	0.11
156	300782	卓胜微	3,800	1,241,840.00	0.10
157	603886	元祖股份	52,691	1,240,873.05	0.10
158	300015	爱尔眼科	29,116	1,231,024.48	0.10
159	002034	旺能环境	70,700	1,220,989.00	0.10
160	600295	鄂尔多斯	50,400	1,188,936.00	0.10
161	603517	绝味食品	17,300	1,182,109.00	0.10
162	600845	宝信软件	19,310	1,174,627.30	0.10
163	002557	洽洽食品	18,700	1,147,432.00	0.10
164	600782	新钢股份	214,700	1,133,616.00	0.10
165	300363	博腾股份	12,500	1,118,125.00	0.09
166	300775	三角防务	22,200	1,085,358.00	0.09
167	600383	金地集团	82,600	1,071,322.00	0.09
168	600999	招商证券	60,300	1,064,295.00	0.09
169	002436	兴森科技	75,200	1,052,800.00	0.09
170	600487	亨通光电	68,800	1,040,256.00	0.09
171	688026	洁特生物	11,514	1,015,074.24	0.09
172	603610	麒盛科技	38,611	998,480.46	0.08
173	688356	键凯科技	2,900	977,677.00	0.08
174	002539	云图控股	72,600	963,402.00	0.08
175	002396	星网锐捷	40,400	952,228.00	0.08
176	688357	建龙微纳	4,900	940,506.00	0.08
177	600285	羚锐制药	58,800	929,040.00	0.08
178	688578	艾力斯	28,580	863,116.00	0.07
179	300696	爱乐达	16,600	862,204.00	0.07
180	688036	传音控股	5,266	826,235.40	0.07
181	688232	新点软件	18,893	793,317.07	0.07
182	002850	科达利	4,700	753,598.00	0.06
183	300171	东富龙	14,400	727,776.00	0.06
184	002472	双环传动	26,200	722,596.00	0.06
185	600581	八一钢铁	114,900	713,529.00	0.06

186	002714	牧原股份	13,000	693,680.00	0.06
187	603738	泰晶科技	10,700	634,510.00	0.05
188	600867	通化东宝	57,000	624,720.00	0.05
189	600461	洪城环境	76,200	621,030.00	0.05
190	002007	华兰生物	21,300	620,682.00	0.05
191	002185	华天科技	48,300	613,893.00	0.05
192	300820	英杰电气	6,700	602,330.00	0.05
193	600862	中航高科	16,600	593,616.00	0.05
194	600406	国电南瑞	14,700	588,441.00	0.05
195	600522	中天科技	34,400	583,424.00	0.05
196	300833	浩洋股份	7,200	583,416.00	0.05
197	300294	博雅生物	15,100	579,085.00	0.05
198	000656	金科股份	128,100	573,888.00	0.05
199	002286	保龄宝	42,100	569,192.00	0.05
200	603855	华荣股份	21,700	548,576.00	0.05
201	601339	百隆东方	87,844	517,401.16	0.04
202	000959	首钢股份	90,000	515,700.00	0.04
203	688099	晶晨股份	3,813	496,452.60	0.04
204	605358	立昂微	4,000	480,040.00	0.04
205	003816	中国广核	152,500	477,325.00	0.04
206	000596	古井贡酒	1,943	474,092.00	0.04
207	688508	芯朋微	4,012	464,830.32	0.04
208	600019	宝钢股份	61,468	440,110.88	0.04
209	603444	吉比特	1,000	421,850.00	0.04
210	601898	中煤能源	65,200	410,108.00	0.03
211	300661	圣邦股份	1,300	401,700.00	0.03
212	300772	运达股份	9,000	395,820.00	0.03
213	603392	万泰生物	1,740	385,410.00	0.03
214	688598	金博股份	1,000	355,040.00	0.03
215	600875	东方电气	14,400	308,448.00	0.03
216	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.03
217	002080	中材科技	8,700	295,974.00	0.02
218	688190	云路股份	3,026	279,935.26	0.02
219	300595	欧普康视	4,600	263,902.00	0.02
220	601016	节能风电	39,000	253,890.00	0.02
221	688016	心脉医疗	1,000	248,740.00	0.02
222	600732	爱旭股份	10,600	247,616.00	0.02
223	688005	容百科技	2,100	242,718.00	0.02
224	600123	兰花科创	25,900	242,683.00	0.02
225	601816	京沪高铁	50,000	241,500.00	0.02
226	002056	横店东磁	10,500	198,135.00	0.02
227	000598	兴蓉环境	30,600	193,392.00	0.02

228	601001	晋控煤业	20,100	193,161.00	0.02
229	688368	晶丰明源	601	192,380.10	0.02
230	601601	中国太保	6,774	183,710.88	0.02
231	000012	南玻 A	17,800	176,754.00	0.01
232	601778	晶科科技	18,800	160,364.00	0.01
233	601006	大秦铁路	24,000	153,600.00	0.01
234	600926	杭州银行	11,800	151,276.00	0.01
235	603486	科沃斯	1,000	150,950.00	0.01
236	601021	春秋航空	2,400	136,320.00	0.01
237	300390	天华超净	1,600	129,600.00	0.01
238	002831	裕同科技	3,700	124,653.00	0.01
239	300223	北京君正	900	120,600.00	0.01
240	601211	国泰君安	6,400	114,496.00	0.01
241	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.01
242	688210	统联精密	2,218	87,677.54	0.01
243	300260	新莱应材	1,800	84,906.00	0.01
244	688050	爱博医疗	402	84,512.46	0.01
245	688786	悦安新材	1,513	81,717.13	0.01
246	301177	迪阿股份	608	70,576.64	0.01
247	688071	华依科技	1,101	68,603.31	0.01
248	301087	可孚医疗	848	63,888.32	0.01
249	002459	晶澳科技	600	55,620.00	0.00
250	601155	新城控股	1,800	52,434.00	0.00
251	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
252	688038	中科通达	2,132	39,911.04	0.00
253	600141	兴发集团	1,000	37,880.00	0.00
254	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
255	600882	妙可蓝多	600	33,600.00	0.00
256	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
257	688701	卓锦股份	2,340	31,590.00	0.00
258	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
259	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
260	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
261	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
262	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
263	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
264	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
265	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
266	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
267	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
268	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
269	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00

270	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
271	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
272	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
273	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
274	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
275	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
276	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
277	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
278	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
279	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
280	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
281	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
282	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
283	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
284	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
285	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
286	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
287	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
288	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
289	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
290	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
291	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
292	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
293	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
294	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
295	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
296	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
297	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
298	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
299	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
300	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
301	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
302	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
303	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
304	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
305	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
306	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
307	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
308	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
309	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
310	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
311	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00

312	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
313	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
314	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
315	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
316	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
317	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
318	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
319	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
320	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
321	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
322	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
323	871245	威博液压	200	1,936.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	82,264,767.60	6.49
2	601668	中国建筑	71,388,433.00	5.63
3	600036	招商银行	66,376,940.00	5.24
4	600887	伊利股份	61,259,412.00	4.83
5	600030	中信证券	56,390,462.80	4.45
6	601318	中国平安	54,568,773.97	4.30
7	600919	江苏银行	53,314,434.19	4.20
8	002142	宁波银行	49,988,572.26	3.94
9	000858	五粮液	49,060,467.00	3.87
10	600809	山西汾酒	46,615,646.20	3.68
11	601012	隆基股份	46,146,922.88	3.64
12	600309	万华化学	46,080,014.00	3.63
13	300059	东方财富	45,700,892.47	3.60
14	600019	宝钢股份	43,559,062.36	3.44
15	300122	智飞生物	42,746,917.68	3.37
16	000651	格力电器	42,347,846.00	3.34
17	000725	京东方 A	42,272,544.00	3.33
18	000001	平安银行	41,968,099.82	3.31
19	300750	宁德时代	38,489,587.14	3.04
20	002736	国信证券	38,474,461.00	3.03
21	603259	药明康德	37,965,694.32	2.99
22	601328	交通银行	37,796,923.00	2.98
23	000333	美的集团	36,901,171.00	2.91
24	601336	新华保险	36,689,171.90	2.89



25	601211	国泰君安	34,886,867.00	2.75
26	002415	海康威视	34,021,089.00	2.68
27	601618	中国中冶	33,869,934.45	2.67
28	601601	中国太保	33,161,255.92	2.62
29	600176	中国巨石	32,776,218.95	2.59
30	002129	中环股份	32,766,411.00	2.58
31	002410	广联达	31,995,041.81	2.52
32	601928	凤凰传媒	31,889,787.27	2.52
33	600132	重庆啤酒	31,389,148.76	2.48
34	601939	建设银行	31,270,665.00	2.47
35	600502	安徽建工	31,154,558.06	2.46
36	601229	上海银行	30,984,340.76	2.44
37	601225	陕西煤业	29,854,951.00	2.35
38	600690	海尔智家	29,792,443.00	2.35
39	000100	TCL 科技	29,647,396.75	2.34
40	601898	中煤能源	29,488,285.71	2.33
41	601838	成都银行	27,838,491.06	2.20
42	601377	兴业证券	25,781,201.00	2.03
43	000425	徐工机械	25,598,257.00	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。

#### 8.4.2 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	600519	贵州茅台	85,790,497.46	6.77
2	600036	招商银行	81,243,974.84	6.41
3	601318	中国平安	70,812,031.13	5.58
4	000001	平安银行	66,969,751.34	5.28
5	600809	山西汾酒	65,138,417.60	5.14
6	600919	江苏银行	63,829,238.68	5.03
7	600887	伊利股份	59,020,886.00	4.65
8	300059	东方财富	58,766,652.10	4.63
9	601668	中国建筑	57,020,584.00	4.50
10	000858	五粮液	55,626,067.40	4.39
11	601211	国泰君安	53,679,052.91	4.23
12	601166	兴业银行	49,573,735.65	3.91
13	600309	万华化学	48,836,727.06	3.85
14	000333	美的集团	48,789,257.25	3.85
15	601225	陕西煤业	43,600,080.44	3.44
16	600019	宝钢股份	41,808,407.23	3.30
17	000725	京东方 A	41,617,995.00	3.28

18	601377	兴业证券	38,905,072.70	3.07
19	002142	宁波银行	38,420,628.44	3.03
20	000651	格力电器	36,636,560.00	2.89
21	002736	国信证券	36,370,306.00	2.87
22	603259	药明康德	34,740,972.54	2.74
23	300122	智飞生物	34,224,668.12	2.70
24	601601	中国太保	34,026,394.52	2.68
25	002410	广联达	33,812,644.66	2.67
26	300124	汇川技术	33,779,316.28	2.66
27	601328	交通银行	32,774,157.00	2.58
28	600030	中信证券	32,611,684.34	2.57
29	601336	新华保险	32,588,638.70	2.57
30	601229	上海银行	32,412,014.12	2.56
31	601618	中国中冶	31,528,874.00	2.49
32	601888	中国中免	31,359,119.65	2.47
33	601928	凤凰传媒	30,326,762.00	2.39
34	601012	隆基股份	29,713,546.50	2.34
35	601898	中煤能源	29,660,803.47	2.34
36	300015	爱尔眼科	28,990,789.74	2.29
37	601155	新城控股	28,548,428.62	2.25
38	600132	重庆啤酒	28,402,219.00	2.24
39	002271	东方雨虹	28,002,584.52	2.21
40	601636	旗滨集团	27,764,277.06	2.19
41	002241	歌尔股份	26,931,227.00	2.12
42	601919	中远海控	26,744,244.04	2.11
43	600176	中国巨石	26,363,244.23	2.08
44	688981	中芯国际	26,215,764.14	2.07
45	601838	成都银行	25,985,941.13	2.05
46	603882	金域医学	25,934,605.90	2.05
47	000799	酒鬼酒	25,850,205.00	2.04
48	000425	徐工机械	25,730,340.00	2.03

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,198,720,229.77
卖出股票收入（成交）总额	5,296,152,638.26

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	266,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	266,000.00	0.02

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113052	兴业转债	2,360	236,000.00	0.02
2	113634	珀莱转债	300	30,000.00	0.00

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC2201	中证 500 股指期货 2201 合约	-25	-36,889,000.00	-807,920.00	本报告期内，本基金继续采用完全对冲策略，通过量化选股模型构建指数增强股票组合，同时利用相应的股指期货合约进行对冲，以获取绝对收益。
IC2203	中证 500 股指期货 2203 合约	-20	-29,223,200.00	-352,360.00	
IF2203	沪深 300 股指期货 2203 合约	-540	-801,997,200.00	3,714,840.00	
公允价值变动总额合计（元）					2,554,560.00
股指期货投资本期收益（元）					-111,775,272.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					77,122,692.00

注：买入持仓以正数表示，卖出持仓以负数表示。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可投资国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 911,418,344.11 元，占基金资产净值的比例为 76.68%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-868,109,400.00 元，占基金资产净值的比例为-73.04%，空头合约市值占股票资产的比例为-95.25%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 43,482,747.57 元，公允价值变动损益为-28,985,636.86 元。

### 8.13 投资组合报告附注

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

1、兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码：601166）于 2021 年 8 月 13 日收到中国人民银行出具的行政处罚决定书（银罚字〔2021〕26 号），其因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，被处以罚款人民币 5 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

序对兴业银行进行了投资。

2、招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，股票代码：600036）于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字〔2021〕16 号）。其因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品、理财产品之间风险隔离不到位等二十七项违法违规事实，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，被处以罚款 7170 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招商银行进行了投资。

3、其余八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。

### 8.13.2 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。

### 8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	105,818,708.47
2	应收证券清算款	90,819.57
3	应收股利	-
4	应收利息	63,309.29
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	105,972,837.33

### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 8.13.6 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 (%)
14,677	78,590.72	1,033,938,744.84	89.64	119,537,210.03	10.36

### 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	48,917.08	0.004241

### 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。

### 9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,000.10	0.87	10,001,000.10	0.36	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	不适用
基金经理等人员	-	-	-	-	不适用
基金管理人股东	-	-	-	-	不适用
其他	-	-	-	-	不适用
合计	10,001,000.10	0.87	10,001,000.10	0.36	-

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020年2月27日) 基金份额总额	2,803,947,219.94
--------------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	1,249,696,567.30
本报告期基金总申购份额	1,200,620,167.40
减：本报告期基金总赎回份额	1,296,840,779.83
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	1,153,475,954.87

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 2 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 100,000.00 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	
东方证券股份有限公司	3	10,460,085,193.90	100.00%	850,458.58	100.00%	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	本期新增
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-



华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
瑞信证券（中国）有限公司	2	-	-	-	-	
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	
申港证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	
太平洋证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
天风证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
招商证券股份有限公司	3	-	-	-	-	本期新增 2 个
中航证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期新增 1 个
中信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	本期新增 1 个
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

a、资金实力雄厚，信誉良好；

b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

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

## 2) 选择程序

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券股份有限公司	6,099,654.96	100.00%	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任	-	-	-	-	-	-

公司						
国泰君安证券股份 有限公司						
海通证券股份有限 公司						
恒泰证券股份有限 公司						
华创证券有限责任 公司						
华西证券股份有限 公司						
民生证券股份有限 公司						
平安证券股份有限 公司						
瑞信证券（中国） 有限公司						
瑞银证券有限责任 公司						
申港证券股份有限 公司						
申万宏源证券有限 公司						
太平洋证券股份有 限公司						
天风证券股份有限 公司						
兴业证券股份有限 公司						
长城证券股份有限 公司						
招商证券股份有限 公司						
中航证券股份有限 公司						
中泰证券股份有限 公司						
中国国际金融股份 有限公司						
中国银河证券股份 有限公司						
中信建投证券股份 有限公司						
中信证券股份有限						

公司						
中银国际证券股份 有限公司						

### 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	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
4	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
5	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
6	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
7	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2021 年 2 月 5 日至 2021 年 2 月 18 日第四个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-02
8	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2021 年 2 月 5 日至 2021 年 2 月 18 日第四个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-03
9	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2021 年 2 月 5 日至 2021 年 2 月 18 日第四个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	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
14	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
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	2021-03-20
16	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
17	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
18	关于景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放期提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-26
19	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
20	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
21	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
22	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
23	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
24	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
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	2021-04-19
26	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
27	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
28	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
29	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
30	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

31	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2021 年 5 月 14 日至 2021 年 5 月 20 日第五个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
32	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2021 年 5 月 14 日至 2021 年 5 月 20 日第五个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-13
33	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2021 年 5 月 14 日至 2021 年 5 月 20 日第五个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-14
34	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分新增招商银行股份有限公司招赢通平台为销售平台及参加申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-19
35	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
36	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
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	2021-06-15
38	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 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
39	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
40	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
41	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
42	关于景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放期提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-24
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	2021-07-09
44	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

45	关于旗下部分基金新增挖财基金为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-14
46	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
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	2021-07-20
48	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-21
49	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-21
50	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
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	2021-07-27
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	2021-08-06
53	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2021 年 8 月 13 日至 2021 年 8 月 19 日第六个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-11
54	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2021 年 8 月 13 日至 2021 年 8 月 19 日第六个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-12
55	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2021 年 8 月 13 日至 2021 年 8 月 19 日第六个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-13
56	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
57	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
58	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-23
59	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-27
60	景顺长城基金将积极参与投资北京证	中国证监会指定报刊及	2021-09-07

	券交易所上市企业	网站	
61	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增好买基金为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-13
62	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增爱建基金为销售机构并开通基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-17
63	关于景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放期提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-24
64	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承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	2021-09-30
65	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
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	2021-10-15
67	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-22
68	关于景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金新增天风证券为销售机构并开通基金转换业务及参加申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-25
69	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
70	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-27
71	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2021 年 11 月 12 日至 2021 年 11 月 18 日第七个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-09
72	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2021 年 11 月 12 日至 2021 年 11 月 18 日第七个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-10



	告		
73	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金关于 2021 年 11 月 12 日至 2021 年 11 月 18 日第七个开放期开放申购、赎回及转换业务和规模控制安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-11
74	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上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
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	2021-11-18
76	关于旗下部分基金新增创金启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	2021-11-25
77	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
78	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 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
79	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-30
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	2021-12-03
81	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
82	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
83	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
84	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
85	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
86	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者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210101-20210819; 20211115-20211231	400,139,000.00	-	95,000,000.00	305,139,000.00	26.45
	2	20210101-20210815	383,508,496.24	-	383,508,496.24	-	-

#### 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量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；

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

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

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

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

### 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