

# 景顺长城泰祥回报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：上海银行股份有限公司

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。

基金托管人上海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。

安永华明会计师事务所（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，请投资者仔细阅读。

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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
<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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<b>§5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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
<b>§6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22

<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
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.....	59
8.12 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.....	63
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.....	63
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>63</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.....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	65
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>69</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.....	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>70</b>
13.1 备查文件目录.....	70
13.2 存放地点.....	70
13.3 查阅方式.....	70

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城泰祥回报混合
基金主代码	010478
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 11 月 23 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	842,577,963.18 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，寻求基金资产的长期稳健增值，力争获得超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	<p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况，在权益类资产、固定收益类资产和现金类资产三大类资产类别间进行相对灵活的配置，资产配置组合主要以债券等固定收益类资产配置为主，并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例，使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上优化投资组合。</p> <p>（二）债券投资策略 债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>（三）资产支持证券投资策略 本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>（四）股票投资策略 本基金通过基金经理的战略性选股思路以及投研部门的支持，筛选出价值优势明显的优质股票构建股票投资组合。在股票投资方面，本基金利用基金管理人股票研究数据库（SRD）对企业内在价值进行深入细致的分析，并进一步挖掘出受益于中国经济发展趋势和投资主题的公司股票进行投资。</p> <p>（五）股指期货投资策略 本基金参与股指期货交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。</p> <p>（六）国债期货投资策略 本基金可基于谨慎原则，将根据风险</p>

	<p>管理的原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>（七）股票期权投资策略 本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p>（八）融资策略 本基金在参与融资业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。</p>
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×75% + 沪深 300 指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金还可投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳	周直毅
	联系电话	0755-82370388	021-68475608
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@bosscn.com
客户服务电话		4008888606	95594
传真		0755-22381339	021-68476936
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 27 层
邮政编码		518048	200120
法定代表人		李进	金煜

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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 11 月 23 日(基金合同生效日) -2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	33,322,583.32	1,079,200.81
本期利润	31,334,075.98	1,086,600.81
加权平均基金份额本期利润	0.0602	0.0054
本期加权平均净值利润率	5.80%	0.54%
本期基金份额净值增长率	5.13%	1.18%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	53,715,081.00	402,774.50
期末可供分配基金份额利润	0.0638	0.0119
期末基金资产净值	896,293,044.18	34,307,472.02
期末基金份额净值	1.0637	1.0118
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	6.37%	1.18%

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。

5、本基金基金合同生效日为 2020 年 11 月 23 日。

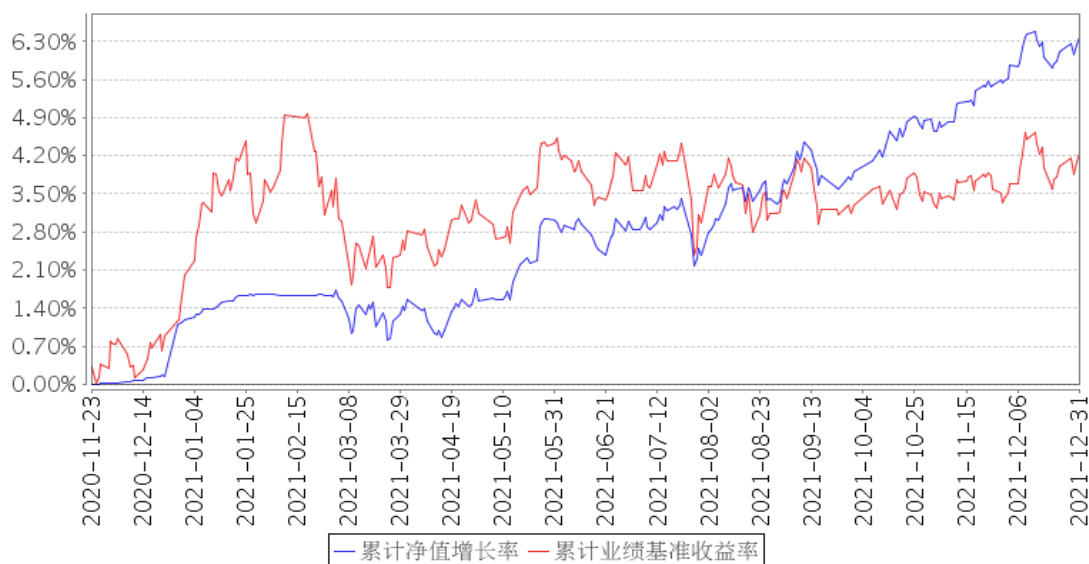
## 3.2 基金净值表现

### 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	2.37%	0.14%	0.94%	0.19%	1.43%	-0.05%
过去六个月	3.28%	0.17%	0.09%	0.25%	3.19%	-0.08%
过去一年	5.13%	0.16%	2.21%	0.28%	2.92%	-0.12%
自基金合同生效起至今	6.37%	0.16%	4.26%	0.28%	2.11%	-0.12%

### 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

景顺长城泰祥回报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



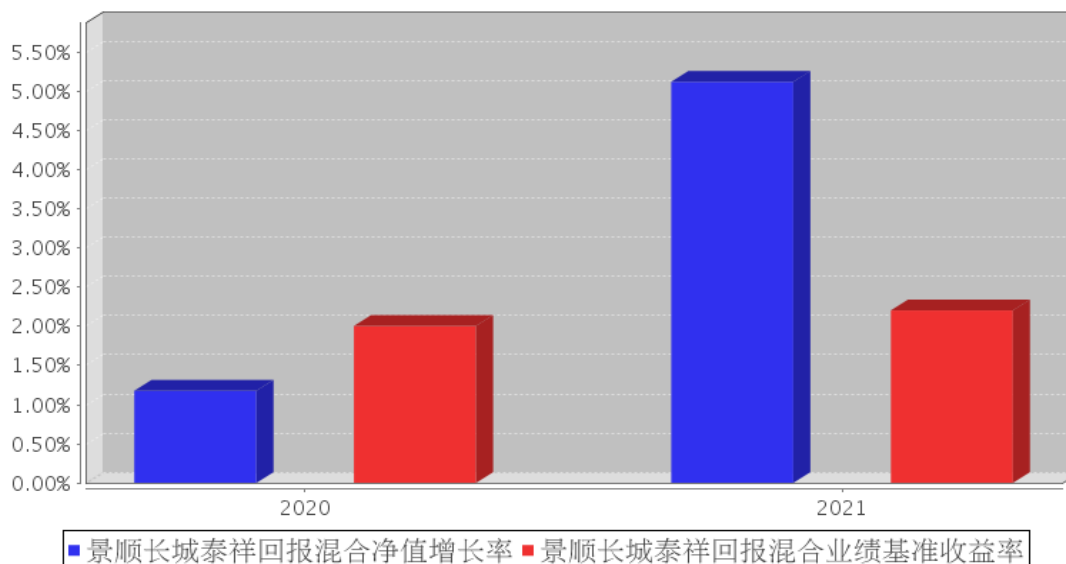
注：本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-50%，其中投资于港股通标的股票比例不超过股票资产的 50%。投资于同业存单比例不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2020 年 11 月 23 日基金合同生效日起 6 个月。建仓



期结束时，本基金投资组合均达到上述投资组合比例的要求。报告期末距离建仓结束期未满一年。

### 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

景顺长城泰祥回报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是 2020 年 11 月 23 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11月23日（基金合同生效日）至本报告期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		
毛从蓉	本基金的基金经理	2020 年 11 月 23 日	-	21 年	经济学硕士。曾任职于交通银行及担任长城证券金融研究所债券业务小组组长。2003 年 3 月加入本公司，担任研究部研究员，自 2005 年 6 月起担任基金经理，现任公司副总经理、固定收益部基金经理。具有 21 年证券、基金行业从业经验。
陈莹	本基金的基金经理	2021 年 9 月 10 日	-	7 年	工学硕士。曾任交通银行公司机构部高级行业经理，浙商基金管理有限公司固定收益部信用评级研究员，华安基金管理有限公司固定收益部信用分析师。2019 年 11 月加入本公司，历任固定收益部信用研究员、基金经理助理，自 2020 年 7 月起担任固定收益部基金经理，现任混合资产投资部基金经理。具有 7 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 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、《景顺长城泰祥回报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。

### 4.3 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

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

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

##### 4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理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年全球经济进入后疫情时代,而随着新冠疫情走势分化,中国和全球主要经济体的宏观经济政策也出现分化:中国因为疫情控制情况较好,部分财政刺激政策逐步退出,对于房地产、基建等产业链采取相对紧缩的行业政策,因此,2021年中国宏观经济增速前高后低,逐季回落,整体呈现见顶回落的走势。具体而言,一季度中国的经济运行延续了2020年四季度的向好状态,在出口以及房地产的带动下,经济触及疫情之后的扩张顶点;而自2020年下半年以来的货币政策正常化过程,也逐步约束了经济扩张动能,叠加出口增速边际走弱,3月份成为PMI、生产、信贷等多方面数据的重要拐点,经济开始边际承压;2021年下半年开始,对房地产市场持续高压,部分房企资金压力持续发酵,房地产市场骤冷进一步拖累经济,叠加双碳政策的阶段性压制,中国经济逐步面临失速的风险,虽然政策在四季度已开始纠偏,包括房地产销售、融资政策以及双碳

限制政策边际松动等,但并未阻碍经济增速跌至 4% 的低位,稳增长成为经济工作的重中之重。2021 年以美国为代表的主要海外经济体由于受疫情影响较大,整体还是进一步加大刺激,一季度美国政府的 1.9 万亿美元刺激计划落地,美国内需旺盛,美国国债收益率在一季度大幅回升。进入四季度以后,随着美国国内通胀压力大幅上升,美国加快了宽松政策退出:美联储 Taper 加快,将在 3 月份结束购债计划,而对于美国首次加息的预期也提前到 2022 年上半年。

2021 年全年国内债券市场整体走牛,年初债市收益率有小幅反弹,但自 2 月中下旬以后债券市场收益率一路下行,在 9 月中旬见阶段性低点,随着资管新规整改延长期于四季度最终落地,三季度末收益率的一些波动体现了投资者行为和情绪的短期扰动,进入 10 月份以后收益率有小幅反弹。但随着央行货币政策进一步宽松、而稳信用暂时难见明显效果,收益率继续下行,年底债券市场收益率收在全年的低点。其中 10 年期国开收益率 3.08%,比年初回落近 45BP,1 年期国开债收益率 2.31%,比年初回落近 24bp。

权益方面,一季度 A 股冲高回落,而后指数以震荡为主,但板块之间行情分化严重。全年来看,上证指数上涨 4.8%,沪深 300 下跌 5.2%,而代表景气程度较高板块的创业板指则全年上涨 12%。板块方面,结构性行情演绎仍较为极致,全年来看高景气板块表现最好,其中电力设备和新能源板块涨幅 50.4%,表现最佳,而周期中的钢铁煤炭板块涨幅也超过 40%,而地产、家电、消费者服务等经济相关性较高的行业板块表现落后。

前三季度组合债券部分整体拉长了久期,并适度提高了杠杆水平,四季度立足票息策略,保持适度的杠杆水平。权益部分以绝对收益为主要思路,结构上以稳健低估值品种为主,辅以一部份中长期景气度较为确认的估值相对合理的成长品种。

#### 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 5.13%,业绩比较基准收益率为 2.21%。

#### 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 年上半年,宏观场景判断短期内倾向于“宽货币、宽信用”,目前宽货币已经得到逐步兑现,未来市场关注的重点可能逐步向宽信用逻辑转换,注意在此过程中的风格切换问题。对于 2022 年全年经济,目前判断是全年 5.2% 的经济增长,前高后低,政策的下一个拐点可能在二季度出现。

债券市场方面,虽然目前债券收益率处于历史较低分位数,但考虑到当下经济周期以及货币政策的组合,债券仍然具备一定的配置价值。配置方向依然以高等级信用债为主,继续立足票息策略,待收益率调整之后择机增配长债,同时积极把握因为政策变动带来的银行次级债的投资机会。

权益市场方面，宏观经济运行情况、政策的边际变化（尤其是地产相关的政策）、宽信用预期等是影响当前市场走势的核心矛盾，对此应保持高度关注，需要进行紧密跟踪。我们对后市观点中性偏乐观：一方面，中国经济增长惯性仍在，且存在政策空间，国内经济快速回落的风险并不大；另一方面，前期流动性维持超预期宽松，市场分化到极致，高景气度的赛道股在大幅上涨之后，近期快速下跌，估值风险有所释放，积极关注相关板块调整后的配置机会。配置思路方面，寻找估值和景气度相匹配的板块，关注个股估值的安全边际，逢低吸纳代表消费升级及产业升级趋势的优质龙头。组合配置方向上，一方面，在中低估值的板块中寻找受益于宽信用、景气度边际改善或者有预期差的行业，比如银行、部分受益于原材料价格下跌的中游制造业、家电、汽车零部件（补库逻辑）、交运等；另一方面，择机增配业绩确定性强的消费龙头以及估值合理的具备中长期景气度的优质成长品种，如汽车电动化智能化产业链、光伏产业链、军工产业链等。

#### 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

从 2020 年 12 月 28 日至 2021 年 2 月 26 日，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

## §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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §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	安永华明（2022）审字第 60467014_H48 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	景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。</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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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>
其他信息	<p>景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估景顺长城泰祥回报混合型证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督景顺长城泰祥回报混合型证券投资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</p>

	<p>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>(1) 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>(2) 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>(3) 评价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>(4) 对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，就可能对导致对景顺长城泰祥回报混合型证券投资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泰祥回报混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	昌华 黄拥璇
会计师事务所的地址	中国 北京
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：景顺长城泰祥回报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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	10,473,798.11	14,707,775.98
结算备付金		2,289,240.88	402,380.95

存出保证金		89,746.68	-
交易性金融资产	7.4.7.2	983,090,270.55	10,009,000.00
其中：股票投资		150,778,373.75	-
基金投资		-	-
债券投资		832,311,896.80	10,009,000.00
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	-	14,000,000.00
应收证券清算款		16,315,560.43	-
应收利息	7.4.7.5	11,441,671.02	282,024.51
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		1,023,700,287.67	39,401,181.44
<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		110,329,703.95	-
应付证券清算款		16,224,823.76	-
应付赎回款		-	4,971,861.22
应付管理人报酬		437,436.94	95,136.73
应付托管费		72,906.15	15,856.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	80,903.04	2,809.25
应交税费		50,597.17	1,800.09
应付利息		11,872.48	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	199,000.00	6,246.01
负债合计		127,407,243.49	5,093,709.42
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	842,577,963.18	33,904,600.76
未分配利润	7.4.7.10	53,715,081.00	402,871.26
所有者权益合计		896,293,044.18	34,307,472.02
负债和所有者权益总计		1,023,700,287.67	39,401,181.44

注：（1）报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.0637 元，基金份额总额 842,577,963.18 份。

(2) 本基金财务报表上年度实际可比期间为 2020 年 11 月 23 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：景顺长城泰祥回报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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 11 月 23 日（基金 合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		37,415,224.22	1,230,478.67
1. 利息收入		17,665,418.65	407,620.04
其中：存款利息收入	7.4.7.11	91,396.49	98,002.07
债券利息收入		17,336,751.22	117,904.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		237,270.94	191,713.93
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		21,595,853.40	105,044.12
其中：股票投资收益	7.4.7.12	19,337,341.15	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	267,028.63	105,044.12
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,991,483.62	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,988,507.34	7,400.00
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	142,459.51	710,414.51
减：二、费用		6,081,148.24	143,877.86
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,193,506.64	120,690.79
2. 托管费	7.4.10.2.2	532,251.24	20,115.12
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	480,563.68	2,679.08
5. 利息支出		1,588,784.78	-

其中：卖出回购金融资产支出		1,588,784.78	-
6. 税金及附加		45,649.45	192.87
7. 其他费用	7.4.7.19	240,392.45	200.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		31,334,075.98	1,086,600.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		31,334,075.98	1,086,600.81

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：景顺长城泰祥回报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)	33,904,600.76	402,871.26	34,307,472.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	31,334,075.98	31,334,075.98
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)	808,673,362.42	21,978,133.76	830,651,496.18
其中：1. 基金申购款	1,000,282,716.85	27,909,762.51	1,028,192,479.36
2. 基金赎回款	-191,609,354.43	-5,931,628.75	-197,540,983.18
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)	842,577,963.18	53,715,081.00	896,293,044.18
项目	上年度可比期间 2020 年 11 月 23 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)	222,664,644.05	-	222,664,644.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,086,600.81	1,086,600.81
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)	-188,760,043.29	-683,729.55	-189,443,772.84
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-188,760,043.29	-683,729.55	-189,443,772.84
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)	33,904,600.76	402,871.26	34,307,472.02

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

景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]2515 号文《关于准予景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金注册的批复》的核准，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《景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2020 年 11 月 23 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 222,637,223.15 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 27,420.90 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 222,664,644.05 元，折合 222,664,644.05

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，登记机构为本基金管理人，基金托管人为上海银行股份有限公司。

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交易的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、港股通标的股票、股指期货、国债期货、股票期权、债券（包括但不限于国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、现金，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）。本基金还可以参与融资业务。

本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-50%，其中投资于港股通标的股票比例不超过股票资产的 50%。投资于同业存单比例不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率×75%+沪深 300 指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%。

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颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在具体会计估值核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

## 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

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### （1）金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项。

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主要包括股票、债券和衍生工具等投资。

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、结算备付金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### （2）金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归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。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要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

#### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认金融资产或金融负债，按取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为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；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。

#### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；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，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。



## 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

## 金融资产转移

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资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，按其估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用相关可观察输入值，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，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：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；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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确认。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确认，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。

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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的相关交易费用在发生时按照确定的金额计入交易费用。

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。

其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额计入当期费用。

#### 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 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金额。

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 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 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

#### (1) 境内投资

##### (i) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

##### (ii) 增值税及附加、企业所得税

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税

额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(iii) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。基金从上市公司分配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。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

(2) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

## 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	10,473,798.11	14,707,775.98
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	10,473,798.11	14,707,775.98

### 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	153,478,701.61	150,778,373.75	-2,700,327.86

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	202,341,299.41	202,134,896.80	-206,402.61
	银行间市场	629,251,376.87	630,177,000.00	925,623.13
	合计	831,592,676.28	832,311,896.80	719,220.52
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	985,071,377.89	983,090,270.55	-1,981,107.34	
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	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	10,001,600.00	10,009,000.00	7,400.00
	合计	10,001,600.00	10,009,000.00	7,400.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	10,001,600.00	10,009,000.00	7,400.00	

#### 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

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	14,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	14,000,000.00	-

##### 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的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	1,157.17	20,533.75
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	1,030.10	181.10
应收债券利息	11,439,443.45	257,180.33
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	4,129.33
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	40.30	-
合计	11,441,671.02	282,024.51

## 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	74,502.71	-
银行间市场应付交易费用	6,400.33	2,809.25
合计	80,903.04	2,809.25

## 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	-	6,246.01
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	199,000.00	-
合计	199,000.00	6,246.01

## 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	33,904,600.76	33,904,600.76
本期申购	1,000,282,716.85	1,000,282,716.85
本期赎回（以“-”号填列）	-191,609,354.43	-191,609,354.43

- 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	842,577,963.18	842,577,963.18

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	402,774.50	96.76	402,871.26
本期利润	33,322,583.32	-1,988,507.34	31,334,075.98
本期基金份额交易产生的变动数	24,780,110.23	-2,801,976.47	21,978,133.76
其中：基金申购款	32,827,082.35	-4,917,319.84	27,909,762.51
基金赎回款	-8,046,972.12	2,115,343.37	-5,931,628.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	58,505,468.05	-4,790,387.05	53,715,081.00

#### 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11月23日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	62,259.25	61,543.60
定期存款利息收入	-	35,933.33
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	28,188.57	525.14
其他	948.67	-
合计	91,396.49	98,002.07

#### 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11月23日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	94,483,563.49	-
减：卖出股票成本总额	75,146,222.34	-
买卖股票差价收入	19,337,341.15	-

#### 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11月23日（基金合同生效日）至2020年12月31日



	日	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	405,088,270.55	133,189,953.17
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	399,669,799.50	132,116,844.39
减:应收利息总额	5,151,442.42	968,064.66
买卖债券差价收入	267,028.63	105,044.12

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年11月23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	1,991,483.62	-
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	1,991,483.62	-

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年11月23日(基金合同生效日)至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,988,507.34	7,400.00
股票投资	-2,700,327.86	-
债券投资	711,820.52	7,400.00
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	-1,988,507.34	7,400.00

## 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11月23日(基金合 同生效日)至2020年12月31 日
基金赎回费收入	142,433.15	710,414.51
基金转换费收入	26.36	-
合计	142,459.51	710,414.51

## 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11月23日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
交易所市场交易费用	468,538.68	4.08
银行间市场交易费用	12,025.00	2,675.00
合计	480,563.68	2,679.08

## 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 31日	上年度可比期间 2020年11月23日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
审计费用	70,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
债券托管账户维护费	36,900.00	-
银行划款手续费	13,092.45	200.00
其他	400.00	-
合计	240,392.45	200.00

## 7.4.7.20 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

## 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，本基金无需作披露的重大或有事项。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需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
上海银行股份有限公司(“上海银行”)	基金托管人
长城证券股份有限公司(“长城证券”)	基金管理人的股东
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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年11月23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	3,193,506.64	120,690.79
其中：支付销售机构的客户维护费	147,608.89	-

注：基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

###### 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11月23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	532,251.24	20,115.12
----------------	------------	-----------

注：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 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

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上海银行	30,053,261.10	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2020 年 11 月 23 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上海银行	-	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未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

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固有资金投资本基金。

##### 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11月23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
	上海银行-活期	10,473,798.11	62,259.25	14,707,775.98

注：本基金的活期银行存款由基金托管人上海银行保管，并按银行间同业利率计息。

#### 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

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

#### 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	-
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	-
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	2022年3月	新股流通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-

		6 日	14 日							
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	574	53,433.66	43,245.16	-
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	-

		日								
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4日	2022年5月12日	新股流通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
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	2022年6月	新股流通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-

		月 8 日	15 日							
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	685	41,552.10	66,273.75	-
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	429	50,141.52	49,798.32	-
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	2021	2022	新股流	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-



	智行	年 11 月 25 日	年 6 月 2 日	通受限							
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		-
600941	中国移动	2021 年 12 月 27 日	2022 年 1 月 5 日	新股流通受限	57.58	57.58	1,000	57,580.00	57,580.00		-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 10 日	新股流通受限	21.96	93.40	2,469	54,219.24	230,604.60		-
688110	东芯股份	2021 年 12 月 3 日	2022 年 6 月 10 日	新股流通受限	30.18	40.37	10,346	312,242.28	417,668.02		-
688151	华强科技	2021 年 11 月 29 日	2022 年 6 月 6 日	新股流通受限	35.09	33.82	10,721	376,199.89	362,584.22		-
688187	时代电气	2021 年 8 月 30 日	2022 年 3 月 7 日	新股流通受限	31.38	76.65	16,706	524,234.28	1,280,514.90		-
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		-
688737	中自科技	2021 年 10 月 14 日	2022 年 4 月 22 日	新股流通受限	70.90	55.06	2,186	154,987.40	120,361.16		-
688799	华纳药厂	2021 年 7 月 5 日	2022 年 1 月 13 日	新股流通受限	30.82	40.73	1,917	59,081.94	78,079.41		-
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	12,500	1,250,000.00	1,250,000.00	-

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

本基金于本报告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 64,029,703.95 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
1728022	17 工商银行二级 02	2022 年 1 月 4 日	101.52	74,000	7,512,480.00
1828013	18 建设银行二级 02	2022 年 1 月 4 日	103.40	200,000	20,680,000.00
2128013	21 交通银行小微债	2022 年 1 月 4 日	101.86	200,000	20,372,000.00
2128041	21 广发银行小微债	2022 年 1 月 4 日	100.60	200,000	20,120,000.00
合计				674,000	68,684,480.00

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 46,300,000.00 元，于 2022 年 1 月 4 日前（含当日）先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

### 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 86.21%（上年度末：0.00%）。

#### 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人通过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
<b>资产</b>							
银行存款	10,473,798.11	-	-	-	-	-	10,473,798.11
结算备付金	2,289,240.88	-	-	-	-	-	2,289,240.88
存出保证金	89,746.68	-	-	-	-	-	89,746.68
交易性金融资产	23,048,600.00	40,240,000.00	207,655,400.00	425,114,000.00	136,253,896.80	150,778,373.75	983,090,270.55
应收利息	-	-	-	-	-	11,441,671.02	11,441,671.02
应收证券清算款	-	-	-	-	-	16,315,560.43	16,315,560.43
<b>资产总计</b>	<b>35,901,385.67</b>	<b>40,240,000.00</b>	<b>207,655,400.00</b>	<b>425,114,000.00</b>	<b>136,253,896.80</b>	<b>178,535,605.20</b>	<b>1,023,700,287.67</b>
<b>负债</b>							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	437,436.94	437,436.94
应付托管费	-	-	-	-	-	72,906.15	72,906.15
应付证券清算款	-	-	-	-	-	16,224,823.76	16,224,823.76
卖出回购金融资产款	110,329,703.95	-	-	-	-	-	110,329,703.95
应付交易费用	-	-	-	-	-	80,903.04	80,903.04
应付利息	-	-	-	-	-	11,872.48	11,872.48
应交税费	-	-	-	-	-	50,597.17	50,597.17
其他负债	-	-	-	-	-	199,000.00	199,000.00
<b>负债总计</b>	<b>110,329,703.95</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>17,077,539.54</b>	<b>127,407,243.49</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>-74,428,318.28</b>	<b>40,240,000.00</b>	<b>207,655,400.00</b>	<b>425,114,000.00</b>	<b>136,253,896.80</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>上年度末 2020年12月31日</b>	<b>1个月以内</b>	<b>1-3个月</b>	<b>3个月-1年</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>							
银行存款	14,707,775.98	-	-	-	-	-	14,707,775.98
结算备付金	402,380.95	-	-	-	-	-	402,380.95
交易性金融资产	-	10,009,000.00	-	-	-	-	10,009,000.00
买入返售金融资产	14,000,000.00	-	-	-	-	-	14,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	282,024.51	282,024.51
<b>资产总计</b>	<b>29,110,156.93</b>	<b>10,009,000.00</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>282,024.51</b>	<b>39,401,181.44</b>
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,971,861.22	4,971,861.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	95,136.73	95,136.73
应付托管费	-	-	-	-	-	15,856.12	15,856.12

应付交易费用	-	-	-	-	-	2,809.25	2,809.25
应交税费	-	-	-	-	-	1,800.09	1,800.09
其他负债	-	-	-	-	-	6,246.01	6,246.01
负债总计	-	-	-	-	-	5,093,709.42	5,093,709.42
利率敏感度缺口	29,110,156.93	10,009,000.00	-	-	-	-	-

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利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	市场利率上升 25 个基点	-2,918,446.35	-3,346.89
	市场利率下降 25 个基点	2,961,974.71	3,349.13

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	150,778,373.75	16.82	-	-
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	150,778,373.75	16.82	-	-

#### 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%	6,728,823.00	-
	沪深 300 指数下降 5%	-6,728,823.00	-

#### 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. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 2. 其他事项

###### （1）公允价值

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

###### 各层次金融工具公允价值

于 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划分为第一层次的余额为人民币 147,390,438.86 元，划分为第二层次的余额为人民币 835,699,831.69 元，无划分为第三层次的余额（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第二层次的余额为人民币 10,009,000.00 元，无划分为第一层次和第三层次的余额）。

###### 公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、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或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具；本基金本报告期无净转入（转出）第三层次。

(2) 根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》(财会[2017]7 号)、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》(财会[2017]8 号)、《企业会计准则第 24 号—套期会计》(财会[2017]9 号)、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(财会[2017]14 号) (以上统称新金融工具相关会计准则)，以及《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会[2020]22 号)，自 2022 年 1 月 1 日起，本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

(3) 除上述事项外，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	150,778,373.75	14.73
	其中：股票	150,778,373.75	14.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	832,311,896.80	81.30
	其中：债券	832,311,896.80	81.30
	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	12,763,038.99	1.25
8	其他各项资产	27,846,978.13	2.72
9	合计	1,023,700,287.67	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	208,104.00	0.02
B	采矿业	4,728,623.20	0.53
C	制造业	95,021,923.52	10.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,637,594.00	0.29
E	建筑业	127,919.99	0.01
F	批发和零售业	1,245,642.12	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	4,313,818.00	0.48
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	2,205,706.57	0.25
J	金融业	32,901,914.00	3.67
K	房地产业	2,649,103.00	0.30
L	租赁和商务服务业	987,345.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	3,088,513.50	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	34,387.07	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	623,171.78	0.07
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	150,778,373.75	16.82

### 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	002142	宁波银行	235,800	9,026,424.00	1.01
2	000858	五粮液	28,300	6,301,278.00	0.70
3	600519	贵州茅台	2,900	5,945,000.00	0.66
4	600036	招商银行	117,800	5,738,038.00	0.64
5	002311	海大集团	59,800	4,383,340.00	0.49
6	000333	美的集团	55,500	4,096,455.00	0.46
7	000001	平安银行	234,300	3,861,264.00	0.43

8	603806	福斯特	26,140	3,412,577.00	0.38
9	600887	伊利股份	71,000	2,943,660.00	0.33
10	601398	工商银行	560,900	2,596,967.00	0.29
11	601939	建设银行	428,100	2,508,666.00	0.28
12	300760	迈瑞医疗	6,100	2,322,880.00	0.26
13	600741	华域汽车	81,900	2,317,770.00	0.26
14	300207	欣旺达	52,300	2,204,968.00	0.25
15	300568	星源材质	59,300	2,178,089.00	0.24
16	601166	兴业银行	109,900	2,092,496.00	0.23
17	601012	隆基股份	24,100	2,077,420.00	0.23
18	600048	保利发展	130,800	2,044,404.00	0.23
19	002049	紫光国微	8,200	1,845,000.00	0.21
20	300014	亿纬锂能	15,300	1,808,154.00	0.20
21	601899	紫金矿业	180,800	1,753,760.00	0.20
22	600900	长江电力	74,400	1,688,880.00	0.19
23	000568	泸州老窖	6,600	1,675,542.00	0.19
24	002475	立讯精密	33,900	1,667,880.00	0.19
25	002466	天齐锂业	14,300	1,530,100.00	0.17
26	601818	光大银行	452,000	1,500,640.00	0.17
27	300012	华测检测	55,400	1,488,598.00	0.17
28	300750	宁德时代	2,500	1,470,000.00	0.16
29	601601	中国太保	53,700	1,456,344.00	0.16
30	601021	春秋航空	25,300	1,437,040.00	0.16
31	300059	东方财富	36,600	1,358,226.00	0.15
32	601799	星宇股份	6,400	1,307,200.00	0.15
33	688187	时代电气	16,706	1,280,514.90	0.14
34	002409	雅克科技	15,100	1,225,667.00	0.14
35	002507	涪陵榨菜	30,680	1,159,704.00	0.13
36	601009	南京银行	125,800	1,127,168.00	0.13
37	002727	一心堂	29,000	1,116,790.00	0.12
38	601088	中国神华	46,600	1,049,432.00	0.12
39	300775	三角防务	21,200	1,036,468.00	0.12
40	300258	精锻科技	80,400	1,029,924.00	0.11
41	601888	中国中免	4,500	987,345.00	0.11
42	002415	海康威视	18,600	973,152.00	0.11
43	600585	海螺水泥	24,000	967,200.00	0.11
44	600460	士兰微	17,700	959,340.00	0.11
45	600377	宁沪高速	110,100	949,062.00	0.11
46	603899	晨光文具	14,700	948,297.00	0.11
47	600660	福耀玻璃	20,100	947,514.00	0.11
48	000625	长安汽车	58,880	894,387.20	0.10
49	600690	海尔智家	29,500	881,755.00	0.10

50	600745	闻泰科技	6,300	814,590.00	0.09
51	000933	神火股份	83,900	762,651.00	0.09
52	603218	日月股份	22,800	751,260.00	0.08
53	603259	药明康德	6,200	735,196.00	0.08
54	002126	银轮股份	58,100	729,736.00	0.08
55	601857	中国石油	146,300	718,333.00	0.08
56	002236	大华股份	30,500	716,140.00	0.08
57	000089	深圳机场	96,700	707,844.00	0.08
58	600409	三友化工	80,031	696,269.70	0.08
59	688116	天奈科技	4,552	679,568.08	0.08
60	600426	华鲁恒升	21,300	666,690.00	0.07
61	300347	泰格医药	5,100	651,780.00	0.07
62	300122	智飞生物	5,000	623,000.00	0.07
63	601636	旗滨集团	36,400	622,440.00	0.07
64	000733	振华科技	4,800	596,544.00	0.07
65	000738	航发控制	19,300	584,404.00	0.07
66	603337	杰克股份	24,900	583,905.00	0.07
67	603833	欧派家居	3,900	575,250.00	0.06
68	600674	川投能源	44,800	560,000.00	0.06
69	600989	宝丰能源	31,600	548,576.00	0.06
70	600176	中国巨石	29,832	542,942.40	0.06
71	601233	桐昆股份	25,200	533,736.00	0.06
72	000792	盐湖股份	15,000	530,850.00	0.06
73	600276	恒瑞医药	10,380	526,369.80	0.06
74	601838	成都银行	43,400	520,800.00	0.06
75	603678	火炬电子	6,800	514,420.00	0.06
76	002092	中泰化学	53,500	510,390.00	0.06
77	300630	普利制药	9,200	506,368.00	0.06
78	300593	新雷能	9,300	505,734.00	0.06
79	002508	老板电器	14,000	504,280.00	0.06
80	002352	顺丰控股	7,300	503,116.00	0.06
81	300699	光威复材	5,900	498,432.00	0.06
82	603345	安井食品	2,900	495,262.00	0.06
83	688408	中信博	2,781	490,874.31	0.05
84	002353	杰瑞股份	12,200	488,000.00	0.05
85	002459	晶澳科技	5,200	482,040.00	0.05
86	600399	抚顺特钢	19,300	478,061.00	0.05
87	300124	汇川技术	6,900	473,340.00	0.05
88	603816	顾家家居	6,100	470,676.00	0.05
89	601225	陕西煤业	37,800	461,160.00	0.05
90	600060	海信视像	33,900	455,955.00	0.05
91	688167	炬光科技	2,014	441,066.00	0.05

92	603517	绝味食品	6,400	437,312.00	0.05
93	603882	金域医学	3,800	423,206.00	0.05
94	300986	志特新材	6,600	422,466.00	0.05
95	688110	东芯股份	10,346	417,668.02	0.05
96	688111	金山办公	1,463	387,695.00	0.04
97	601872	招商轮船	91,000	373,100.00	0.04
98	600988	赤峰黄金	24,768	369,043.20	0.04
99	688099	晶晨股份	2,806	365,341.20	0.04
100	688151	华强科技	10,721	362,584.22	0.04
101	603799	华友钴业	3,200	352,992.00	0.04
102	000301	东方盛虹	18,100	350,054.00	0.04
103	603583	捷昌驱动	7,000	347,410.00	0.04
104	600115	中国东航	66,600	343,656.00	0.04
105	002985	北摩高科	2,800	337,288.00	0.04
106	600765	中航重机	6,600	333,234.00	0.04
107	300285	国瓷材料	7,600	323,532.00	0.04
108	300777	中简科技	5,200	321,776.00	0.04
109	003021	兆威机电	4,000	319,400.00	0.04
110	600703	三安光电	8,200	307,992.00	0.03
111	600919	江苏银行	52,300	304,909.00	0.03
112	600383	金地集团	23,500	304,795.00	0.03
113	600298	安琪酵母	5,000	301,800.00	0.03
114	000069	华侨城 A	42,600	299,904.00	0.03
115	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.03
116	688078	龙软科技	4,938	287,391.60	0.03
117	603993	洛阳钼业	50,500	281,790.00	0.03
118	603317	天味食品	10,300	276,143.00	0.03
119	688211	中科微至	3,601	270,075.00	0.03
120	002025	航天电器	3,200	268,640.00	0.03
121	000596	古井贡酒	1,100	268,400.00	0.03
122	002594	比亚迪	1,000	268,120.00	0.03
123	603005	晶方科技	4,800	264,432.00	0.03
124	300725	药石科技	1,800	255,906.00	0.03
125	000768	中航西飞	7,000	255,500.00	0.03
126	600456	宝钛股份	3,500	251,230.00	0.03
127	600845	宝信软件	4,100	249,403.00	0.03
128	300790	宇瞳光学	5,500	248,490.00	0.03
129	601877	正泰电器	4,600	247,894.00	0.03
130	000789	万年青	19,900	243,178.00	0.03
131	300919	中伟股份	1,600	242,416.00	0.03
132	688268	华特气体	2,594	233,978.80	0.03
133	603712	七一二	5,400	233,820.00	0.03

134	002271	东方雨虹	4,400	231,792.00	0.03
135	688087	英科再生	2,469	230,604.60	0.03
136	002643	万润股份	9,700	229,308.00	0.03
137	300782	卓胜微	700	228,760.00	0.03
138	688002	睿创微纳	2,907	228,402.99	0.03
139	600210	紫江企业	23,700	217,566.00	0.02
140	300033	同花顺	1,500	216,870.00	0.02
141	603728	鸣志电器	8,900	211,019.00	0.02
142	002371	北方华创	600	208,212.00	0.02
143	002714	牧原股份	3,900	208,104.00	0.02
144	000776	广发证券	8,400	206,556.00	0.02
145	688798	艾为电子	948	204,768.00	0.02
146	002007	华兰生物	7,000	203,980.00	0.02
147	600958	东方证券	13,700	201,938.00	0.02
148	603730	岱美股份	8,625	201,135.00	0.02
149	002001	新和成	6,400	199,168.00	0.02
150	601778	晶科科技	22,900	195,337.00	0.02
151	601139	深圳燃气	21,900	193,377.00	0.02
152	300454	深信服	1,000	191,000.00	0.02
153	300274	阳光电源	1,300	189,540.00	0.02
154	688019	安集科技	692	189,054.40	0.02
155	600926	杭州银行	14,400	184,608.00	0.02
156	300369	绿盟科技	11,500	182,390.00	0.02
157	300015	爱尔眼科	4,300	181,804.00	0.02
158	600309	万华化学	1,800	181,800.00	0.02
159	600161	天坛生物	6,200	179,552.00	0.02
160	688122	西部超导	1,790	173,522.60	0.02
161	600600	青岛啤酒	1,700	168,300.00	0.02
162	688265	南模生物	2,374	166,298.70	0.02
163	002601	龙佰集团	5,800	165,822.00	0.02
164	002841	视源股份	1,900	154,660.00	0.02
165	300223	北京君正	1,000	134,000.00	0.01
166	688227	品高股份	4,164	133,581.12	0.01
167	688032	禾迈股份	184	129,534.16	0.01
168	688737	中自科技	2,186	120,361.16	0.01
169	601117	中国化学	9,700	116,400.00	0.01
170	000983	山西焦煤	11,500	95,105.00	0.01
171	688799	华纳药厂	1,917	78,079.41	0.01
172	300627	华测导航	1,500	69,000.00	0.01
173	301155	海力风电	685	66,273.75	0.01
174	600941	中国移动	1,000	57,580.00	0.01
175	300115	长盈精密	2,900	57,536.00	0.01

176	301177	迪阿股份	429	49,798.32	0.01
177	301087	可孚医疗	574	43,245.16	0.00
178	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
179	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
180	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
181	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
182	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
183	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
184	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
185	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
186	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
187	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
188	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
189	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
190	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
191	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
192	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
193	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
194	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
195	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
196	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
197	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
198	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
199	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
200	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
201	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
202	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
203	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
204	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
205	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
206	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
207	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
208	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
209	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
210	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
211	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
212	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
213	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
214	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
215	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
216	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
217	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00

218	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
219	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
220	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
221	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
222	301079	邵阳液压	140	3,474.80	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	002142	宁波银行	8,656,372.00	25.23
2	000858	五粮液	7,934,651.91	23.13
3	600036	招商银行	7,223,428.00	21.05
4	600519	贵州茅台	5,765,223.00	16.80
5	000001	平安银行	4,973,681.00	14.50
6	000333	美的集团	4,621,469.00	13.47
7	002311	海大集团	4,377,204.00	12.76
8	601318	中国平安	4,045,902.00	11.79
9	600048	保利发展	3,683,727.03	10.74
10	300207	欣旺达	3,645,090.60	10.62
11	601939	建设银行	3,144,001.00	9.16
12	601398	工商银行	3,088,472.00	9.00
13	300568	星源材质	3,059,235.00	8.92
14	601166	兴业银行	2,992,537.00	8.72
15	600887	伊利股份	2,973,304.00	8.67
16	600900	长江电力	2,714,021.00	7.91
17	603806	福斯特	2,673,757.00	7.79
18	601601	中国太保	2,536,292.00	7.39
19	300760	迈瑞医疗	2,526,368.00	7.36
20	601818	光大银行	2,517,714.00	7.34
21	000568	泸州老窖	2,480,275.00	7.23
22	002727	一心堂	2,332,882.00	6.80
23	001965	招商公路	2,246,167.04	6.55
24	600460	士兰微	2,201,428.00	6.42
25	601012	隆基股份	2,076,643.00	6.05
26	600741	华域汽车	2,075,276.00	6.05
27	600585	海螺水泥	2,053,995.00	5.99
28	603816	顾家家居	2,021,712.00	5.89
29	601021	春秋航空	1,962,572.00	5.72
30	601899	紫金矿业	1,900,818.00	5.54
31	000089	深圳机场	1,674,995.00	4.88
32	300014	亿纬锂能	1,660,914.00	4.84

33	601009	南京银行	1,609,353.00	4.69
34	601088	中国神华	1,597,604.00	4.66
35	300012	华测检测	1,575,732.00	4.59
36	000933	神火股份	1,548,980.00	4.51
37	601225	陕西煤业	1,541,669.42	4.49
38	002475	立讯精密	1,436,288.32	4.19
39	002409	雅克科技	1,327,761.00	3.87
40	300750	宁德时代	1,301,746.00	3.79
41	601799	星宇股份	1,299,365.00	3.79
42	601888	中国中免	1,269,528.73	3.70
43	002466	天齐锂业	1,245,642.00	3.63
44	000625	长安汽车	1,232,802.00	3.59
45	601233	桐昆股份	1,231,789.00	3.59
46	603833	欧派家居	1,214,338.00	3.54
47	600486	扬农化工	1,206,583.00	3.52
48	002049	紫光国微	1,199,385.00	3.50
49	002507	涪陵榨菜	1,199,337.00	3.50
50	600674	川投能源	1,167,979.93	3.40
51	300059	东方财富	1,143,543.00	3.33
52	603899	晨光文具	1,135,532.00	3.31
53	603799	华友钴业	1,127,105.00	3.29
54	002415	海康威视	1,122,124.00	3.27
55	300775	三角防务	1,108,183.00	3.23
56	600409	三友化工	1,092,391.60	3.18
57	000733	振华科技	1,071,560.00	3.12
58	300630	普利制药	1,070,372.00	3.12
59	601636	旗滨集团	1,049,405.00	3.06
60	300258	精锻科技	1,049,080.00	3.06
61	603688	石英股份	1,036,870.98	3.02
62	688235	百济神州	1,017,698.40	2.97
63	603885	吉祥航空	1,016,057.00	2.96
64	600745	闻泰科技	1,015,616.00	2.96
65	688002	睿创微纳	1,011,209.58	2.95
66	600399	抚顺特钢	1,002,559.00	2.92
67	600115	中国东航	999,219.00	2.91
68	600377	宁沪高速	998,492.00	2.91
69	300593	新雷能	998,397.00	2.91
70	600660	福耀玻璃	990,715.00	2.89
71	603337	杰克股份	990,596.00	2.89
72	600276	恒瑞医药	989,997.00	2.89
73	603348	文灿股份	982,639.00	2.86
74	002459	晶澳科技	970,688.00	2.83



75	300122	智飞生物	914,174.00	2.66
76	601857	中国石油	888,886.00	2.59
77	600690	海尔智家	887,014.00	2.59
78	300347	泰格医药	877,189.00	2.56
79	603259	药明康德	854,975.40	2.49
80	002236	大华股份	846,101.00	2.47
81	000301	东方盛虹	835,977.00	2.44
82	600760	中航沈飞	815,127.00	2.38
83	000789	万年青	811,452.00	2.37
84	002126	银轮股份	780,956.00	2.28
85	002092	中泰化学	748,957.00	2.18
86	000596	古井贡酒	743,264.00	2.17
87	603218	日月股份	742,656.00	2.16
88	688116	天奈科技	714,496.80	2.08
89	603786	科博达	693,043.00	2.02
90	600426	华鲁恒升	692,505.00	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	601318	中国平安	2,539,893.00	7.40
2	001965	招商公路	2,404,304.00	7.01
3	300207	欣旺达	2,138,338.76	6.23
4	603816	顾家家居	1,674,957.00	4.88
5	600048	保利发展	1,529,028.00	4.46
6	002727	一心堂	1,481,776.00	4.32
7	603688	石英股份	1,468,150.24	4.28
8	600460	士兰微	1,427,970.00	4.16
9	601225	陕西煤业	1,306,799.00	3.81
10	600486	扬农化工	1,306,233.00	3.81
11	600900	长江电力	1,299,884.00	3.79
12	600036	招商银行	1,289,447.00	3.76
13	603348	文灿股份	1,225,858.00	3.57
14	000568	泸州老窖	1,124,107.00	3.28
15	688303	大全能源	1,069,235.02	3.12
16	603885	吉祥航空	1,042,314.00	3.04
17	000733	振华科技	1,021,702.00	2.98
18	301155	海力风电	1,009,956.50	2.94
19	688798	艾为电子	987,800.00	2.88
20	000089	深圳机场	970,913.00	2.83
21	601088	中国神华	949,326.00	2.77

22	000933	神火股份	931,566.00	2.72
23	603786	科博达	903,709.00	2.63
24	688235	百济神州	881,989.98	2.57
25	600760	中航沈飞	867,920.00	2.53
26	300037	新宙邦	855,828.00	2.49
27	688728	格科微	826,884.70	2.41
28	603799	华友钴业	779,499.00	2.27
29	603806	福斯特	752,362.00	2.19
30	688082	盛美上海	747,081.32	2.18
31	603833	欧派家居	743,260.00	2.17
32	002241	歌尔股份	735,746.00	2.14
33	601636	旗滨集团	731,673.00	2.13
34	300568	星源材质	723,581.00	2.11
35	600115	中国东航	719,969.00	2.10
36	300630	普利制药	718,984.00	2.10
37	002439	启明星辰	707,736.00	2.06
38	603010	万盛股份	698,017.60	2.03
39	601233	桐昆股份	686,735.00	2.00

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	228,624,923.95
卖出股票收入（成交）总额	94,483,563.49

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	19,632,000.00	2.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,520,000.00	8.98
	其中：政策性金融债	40,028,000.00	4.47
4	企业债券	191,650,000.00	21.38
5	企业短期融资券	90,363,000.00	10.08
6	中期票据	324,522,000.00	36.21
7	可转债（可交换债）	1,481,896.80	0.17
8	同业存单	-	-
9	其他	124,143,000.00	13.85
10	合计	832,311,896.80	92.86

**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	210206	21 国开 06	400,000	40,028,000.00	4.47
2	1828006	18 中国银行二级 01	300,000	31,065,000.00	3.47
3	101754092	17 扬城建 MTN001	300,000	30,570,000.00	3.41
4	102001885	20 南通城建 MTN002	300,000	30,501,000.00	3.40
5	101800994	18 外滩 MTN002	300,000	30,285,000.00	3.38

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金参与股指期货交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

1、时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

2、套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

3、合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金可基于谨慎原则，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 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 投资组合报告附注

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

1、中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”，股票代码：601988, 3988.HK）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）11 号)。其因向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款、违规向关系人发放信用贷款、向无资金缺口企业发放流动资金贷款、存款月末冲时点等三十六项违反违规事实，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条，《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第七十四条和相关审慎经营规则，被处以 8761.355 万元罚款。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对中国银行进行了投资。

2、宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”，股票代码：002142）于 2021 年 12 月 29 日收到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局出具的行政处罚决定书(甬银保监罚决字（2021）81 号)。其因信用卡业务管理不到位，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条等规定，被处以罚款人民币 30 万元。

2021 年 6 月 10 日，宁波银行因代理销售保险不规范，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、第四十八条第（一）项的相关规定，收到宁波银保监局出具的行政处罚决定书（甬银保监罚决字（2021）36 号），被处以罚款人民币 25 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

2021 年 7 月 30 日，宁波银行因贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储、开发贷款支用审核不严、房地产贷款放款和支用环节审核不严、贷款资金违规流入房市、房地产贷款资金回流借款人、票据业务开展不审慎，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条的规定，收到宁波银保监局出具的行政处罚决定书（甬银保监罚决字（2021）57 号），被处以罚款人民币 275 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

2021 年 7 月 13 日，宁波银行因违规为存款人多头开立银行结算账户、超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料等，收到中国人民银行宁波市中心支行出具的行政处罚决定书（甬银处罚字（2021）2 号），被给予警告，并处罚款 286.2 万元。

2021 年 7 月 13 日，宁波银行因违反规定办理经常项目外汇业务、违反规定办理资本项目资金收付，收到外管局宁波分局出具的行政处罚决定书（甬外管罚(2021)7 号），被罚款 100 万，没收违法所得 104.85 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宁波银行进行了投资。

3、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。

4、2021 年 5 月 28 日，平安银行收到中国银保监会云南监管局出具的行政处罚决定书（云银保监罚决字〔2021〕34 号），其因利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险等违法违规事实，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项相关规定，被处以罚款人民币 210 万元。

2021 年 5 月 10 日，平安银行资金运营中心收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书（沪银保监罚决字〔2021〕55 号），其因违规向未取得土地使用权证的房地产项目提供融资等违法违规事实，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项相关规定，被处以罚款人民币 300 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平安银行进行了投资。

5、中国工商股份有限公司（以下简称“工商银行”，股票代码：601398），其私人银行部于 2021 年 5 月 10 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书(沪银保监罚决字〔2021〕54 号)。其因部分理财产品交易存在利益输送，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项的相关规定，被处以 50 万元罚款。

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工商银行进行了投资。

6、其余五名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内

受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	89,746.68
2	应收证券清算款	16,315,560.43
3	应收股利	-
4	应收利息	11,441,671.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,846,978.13

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110079	杭银转债	4,981.60	0.00

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
389	2,166,010.19	841,785,244.14	99.91	792,719.04	0.09

### 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	0.99	0.0000001

### 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（2020年11月23日） 基金份额总额	222,664,644.05
本报告期期初基金份额总额	33,904,600.76
本报告期基金总申购份额	1,000,282,716.85
减：本报告期基金总赎回份额	191,609,354.43
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	842,577,963.18

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：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

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

本基金聘请的安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 1 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 70,000.00 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	
中国国际金融股份有限公司	2	302,730,312.10	100.00%	281,937.30	100.00%	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、本基金与景顺长城泰申回报混合型证券投资基金共用交易单元。

## 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
中国国际金融股份有限公司	238,584,699.29	100.00%	3,686,374,000.00	100.00%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

## 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	关于景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金新增好买基金等公司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	2021-01-11
3	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2021-01-15

	停机维护的公告	网站	
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金 2021 年非港股通交易日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回及转换业务安排的公告	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旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-04
6	关于景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金新增汇成基金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	2021-02-04
7	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
8	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
9	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
10	关于旗下部分基金新增中国国际金融股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-26
11	关于景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金新增汇林保大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	2021-03-05
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	2021-03-12
13	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
14	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
15	关于景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金新增挖财基金等公司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	2021-03-24
16	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
17	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
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	2021-04-02

19	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
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	2021-04-15
21	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
22	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
23	景顺长城泰祥回报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
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	2021-04-23
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	2021-05-12
26	关于旗下部分基金新增腾安基金为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购、赎回费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-14
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	2021-05-20
28	景顺长城泰祥回报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	2021-05-28
29	景顺长城泰祥回报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	2021-05-28
30	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
31	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
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	2021-06-18
33	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
34	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
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	2021-07-16
36	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
37	关于景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金限制接受壹万元以上申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-21
38	景顺长城泰祥回报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

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	2021-07-23
40	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-27
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	2021-08-06
42	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
43	景顺长城泰祥回报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
44	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-27
45	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
46	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-10
47	景顺长城泰祥回报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	2021-09-11
48	景顺长城泰祥回报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	2021-09-11
49	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-27
50	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-12
51	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-13
52	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
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	2021-10-15
54	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
55	景顺长城泰祥回报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
56	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
57	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-18
58	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2021-12-03

	停机维护的公告	网站	
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	2021-12-10
60	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
61	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
62	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-22
63	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
64	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-28
65	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	20210204-20210228	-	4,927,693.06	4,927,693.06	-	-
	2	20210301-20210715	-	147,578,709.17	147,578,709.17	-	-
	3	20210705-20210707; 20210830-20211028	-	145,737,049.78	-	145,737,049.78	17.30
	4	20210301-20211231	-	196,770,956.32	-	196,770,956.32	23.35

#### 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

无。

## §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泰祥回报混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城泰祥回报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