

# 长江量化消费精选股票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:长江证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2021年1月27日（基金合同生效日）起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	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	15
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	15
§5 托管人报告	16
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
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	57
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	58
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	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58

8.12 投资组合报告附注 .....	58
§9 基金份额持有人信息 .....	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
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 .....	60
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	60
§10 开放式基金份额变动 .....	61
§11 重大事件揭示 .....	61
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	63
§12 备查文件目录 .....	66
12.1 备查文件目录 .....	66
12.2 存放地点 .....	66
12.3 查阅方式 .....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金	
基金简称	长江量化消费精选	
基金主代码	010801	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年01月27日	
基金管理人	长江证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	111,328,379.16份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长江量化消费精选A	长江量化消费精选C
下属分级基金的交易代码	010801	010802
报告期末下属分级基金的份额总额	92,457,925.75份	18,870,453.41份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化投资模型，精选消费主题相关的优质企业进行投资，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥公司资源优势、构建高质量的基础数据库，自上而下的资产配置策略确定各类标的资产的配置比例，并对组合进行动态管理，进一步优化各类资产的比例以优化组合收益风险比。在股票投资过程中，本基金将坚持以量化模型驱动的投资决策流程，强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险，追求基金资产的长期稳定增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中证全指主要消费指数*50%+中证全指可选消费指数*40%+银行活期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长江证券（上海）资产管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高杨	龚小武
	联系电话	4001-166-866	021-52629999-212056
	电子邮箱	zgxxpl@cjsc.com.cn	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		4001-166-866	95561
传真		021-80301393	021-62159217
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号世纪汇一座27层	福州市湖东路154号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层	上海市银城路167号兴业大厦4楼
邮政编码		200122	200120
法定代表人		周纯	吕家进

## 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.cjzcg1.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）	武汉市武昌区东湖路169号众环大厦
注册登记机构	长江证券（上海）资产管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27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	本期2021年01月27日（基金合同生效日）- 2021年12月31日
--------------	-------------------------------------

标	长江量化消费精选A	长江量化消费精选C
本期已实现收益	-14,578,862.87	-2,859,679.03
本期利润	-14,242,322.56	-2,507,939.84
加权平均基金份额本期利润	-0.1260	-0.1272
本期加权平均净值利润率	-13.53%	-13.81%
本期基金份额净值增长率	-13.63%	-14.11%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2021年末	
期末可供分配利润	-12,982,237.86	-2,737,288.81
期末可供分配基金份额利润	-0.1404	-0.1451
期末基金资产净值	79,857,160.07	16,208,460.84
期末基金份额净值	0.8637	0.8589
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2021年末	
基金份额累计净值增长率	-13.63%	-14.11%

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；表中的“期末”均指报告期最后一日，即2021年12月31日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。（3）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，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。（4）本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年。

## 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

#### 长江量化消费精选A

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	①-③	②-④

				④		
过去三个月	0.70%	1.24%	6.26%	0.93%	-5.56%	0.31%
过去六个月	-12.14%	1.55%	-3.91%	1.16%	-8.23%	0.39%
自基金合同生效起至今	-13.63%	1.24%	-8.87%	1.21%	-4.76%	0.03%

## 长江量化消费精选C

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	0.55%	1.24%	6.26%	0.93%	-5.71%	0.31%
过去六个月	-12.40%	1.55%	-3.91%	1.16%	-8.49%	0.39%
自基金合同生效起至今	-14.11%	1.24%	-8.87%	1.21%	-5.24%	0.03%

注：（1）本基金基金合同生效日为 2021 年 1 月 27 日，截至本报告期末未满一年。（2）本基金的业绩比较基准为中证全指主要消费指数\*50%+中证全指可选消费指数\*40%+银行活期存款利率(税后)\*10%。

### 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

长江量化消费精选A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年01月27日-2021年12月31日)

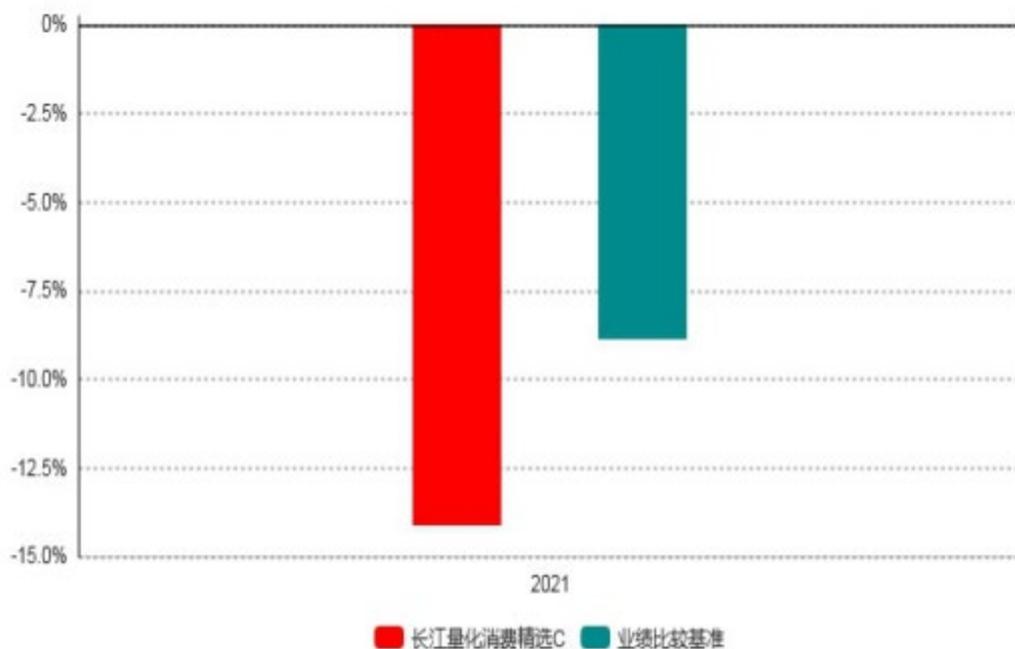
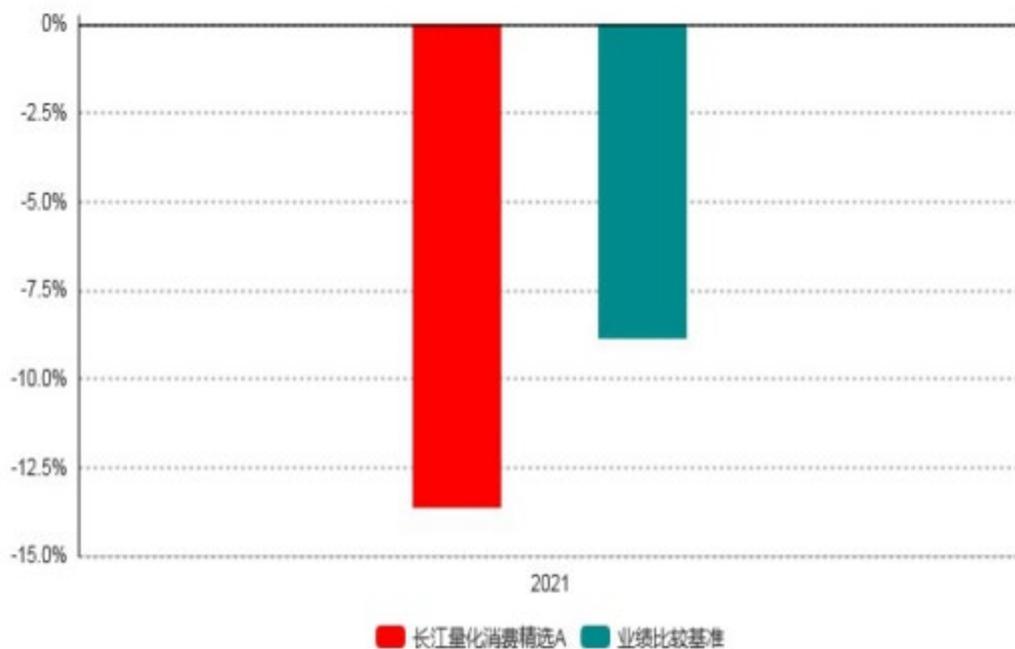


长江量化消费精选C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年01月27日-2021年12月31日)



注：（1）本基金基金合同生效日为 2021 年 1 月 27 日，截至本报告期末未满一年。（2）本基金建仓期为基金合同生效日起 6 个月内，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

### 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



注：本基金基金合同于 2021 年 1 月 17 日生效，2021 年基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率按当年实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于2021年1月27日生效，截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

长江证券（上海）资产管理有限公司于2014年9月16日正式成立，是长江证券股份有限公司旗下专门从事证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务的全资子公司。注册地上海，注册资本23亿元人民币。

公司秉承“专业至臻，追求卓越”的理念，致力于为广大投资者创造稳定而丰厚的回报。公司以“客户导向、研究驱动、技术领先、内控先行”为业务发展策略，全方位参与客户资产配置和资产增值全过程，通过深度挖掘客户的投融资需求，紧跟市场创新步伐，以满足客户差异化需求。在严格控制风险的前提下，挑选优质投资品种，丰富创新产品架构，为客户提供多元化资产配置方案。

截至本报告期末，本基金管理人管理的基金有长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐享货币市场基金、长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐越定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、长江量化匠心甄选股票型证券投资基金、长江安盈中短债六个月定期开放债券型证券投资基金、长江添利混合型证券投资基金、长江安享纯债18个月定期开放债券型证券投资基金、长江均衡成长混合型发起式证券投资基金、长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金、长江新能源产业混合型发起式证券投资基金、长江沪深300指数增强型发起式证券投资基金、长江量化科技精选一个月滚动持有股票型发起式证券投资基金、长江双盈6个月持有期债券型发起式证券投资基金、长江红利回报混合型发起式证券投资基金、长江致惠30天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、长江鑫选3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长江智能制造混合型发起式证券投资基金、长江尊利债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
曹紫建	基金经理	2021-01-27	-	7年	国籍：中国。硕士研究生，

					具备基金从业资格。曾任高盛（东京）投资银行分析师、长江证券股份有限公司分析师、长江证券（上海）资产管理有限公司研究员。现任长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金、长江沪深300指数增强型发起式证券投资基金、长江量化科技精选一个月滚动持有股票型发起式证券投资基金基金经理。
秦昌贵	基金经理	2021-05-10	-	16年	国籍：中国。硕士研究生，具备基金从业资格。曾任长江证券有限责任公司衍生产品部研究员，长江证券股份有限公司资产管理总部产品开发部主管、量化投资部主管，长江证券（上海）资产管理有限公司量化投资部总经理，创金合信基金管理有限公司量化投资部副总监、CTA 投资部总监。现任长江证券（上海）资产管理有限公司量化投资部总经理，长江量化匠心甄选股票型证券投资基金、长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金、长江沪深300指数增强型发起式证券投资基金、长江量化科技精选一个月滚动持有股票型

					发起式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	----------------

注：（1）此处的任职日期、离职日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；

（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 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《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

## 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

本基金管理人根据相关法规要求，制定了《长江证券(上海)资产管理有限公司公平交易管理办法》，制度规范了公司各部门相关岗位职责，适用的范围涵盖境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等各类投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节，旨在规范交易行为，严禁利益输送，保证公平交易，保护投资者合法权益。

（一）公司不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，建立研究与投资的业务交流机制，保持通畅的交流渠道，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，创建公平交易的制度环境。

（二）公司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。

（三）公司健全投资授权机制，明确基金投资决策委员会、基金经理等各投资决策主体的职责和权限划分。其他人员不得对基金经理在授权范围内的投资活动进行干预。基金经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过审批程序。

（四）公司建立适用全公司的证券备选池和交易对手库，明确证券备选池和交易对手库的建立和维护程序，并根据不同投资组合各自的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，建立相应的证券备选池和交易对手库，基金经理在此基础上构建具体的投资组合。

(五) 公司建立投资组合投资信息的管理及保密机制, 不同基金经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息应相互隔离。

(六) 公司严格贯彻投资管理职能和交易执行职能相隔离原则, 实行集中交易制度, 确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

(七) 公司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。公司原则上严格禁止同一基金、资产管理计划在同一交易日内进行反向交易, 及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。

(八) 公司相关部门如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为, 应及时向经营管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

(九) 公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、不同时间窗下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析, 并评估是否符合公平交易原则。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定, 通过严格的内部风险控制制度和流程, 对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制, 确保公平对待所管理的所有基金和投资组合, 切实防范利益输送行为。

##### (一) 本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见, 我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析, 我们发现有效配对溢价率均值大部分在1%数量级及以下, 且大部分溢价率均值通过95%置信度下等于0的t检验。

##### (二) 扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取T=3和T=5作为扩展时间窗口, 将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均, 并以此为依据, 进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对(样本数=30), 溢价率均值大部分在1%数量级及以下。

##### (三) 基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的t检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对, 已要求基金经理对价差作出了解释, 根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

本报告期内, 未出现违反公平交易制度的情况, 公司旗下各基金不存在因不公平交易等导致的利益输送行为, 公平交易制度的整体执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金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

今年股票市场呈现结构性走势，大小盘的风格差异贯穿全年，代表大中盘的宽基指数沪深300年初冲高之后大幅回落，代表中小盘的中证500指数经历一季度的整理之后迎来较强走势。在因子表现层面，质量、市值因子表现较弱，成长、一致预期类因子具有相对超额收益。

本基金通过数量化投资模型，精选消费主题相关的优质企业进行投资，利用量化模型系统地从多视角地分析股票历史数据的多维信息，挑选细分行业里的优质公司并不断评估这些公司能否在未来持续保持优质特性。在股票选择方面，我们重点关注上市公司的财务状况及股票的交易状况，优先选择在价值和成长方面较为平衡的个股进行配置，并尽量规避财务杠杆高、现金流缺乏、公司成长稳定性差及运营能力差的公司；同时利用交易指标刻画股票的投机情绪，规避短期投机情绪高的个股。投资管理上，坚持采用量化模型对股票进行筛选和权重分配，优先选择业绩稳定、成长性好、估值具有优势的股票构建组合。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金A类份额净值为0.8637元，C类份额净值为0.8589元；本报告期内，本基金A类份额净值增长率为-13.63%，C类份额净值增长率为-14.11%，同期业绩比较基准收益率为-8.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，从消费板块的基本面来看，消费板块的优质上市公司依然具有很强的盈利能力，在细分领域的护城河依然存在，股价短期的波动并没有改变优质上市公司长期的投资价值。随着我国双循环格局下的政策刺激、居民收入稳步上升等多因素提振内外需，国内消费升级有望持续，消费领域优质公司的前景良好，龙头公司的盈利能力也将体现在市场价格上，利用量化指标筛选出的消费股票组合可以伴随这些优质消费公司的成长而成长。

#### 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，本基金管理人从合规运作、维护基金份额持有人合法利益的角度出发，完善内部控制制度和流程，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实；在对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、报表揭示、定期检查、

专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

1、全面开展对公司各项业务的稽核监察，对公司内控缺失、薄弱环节和风险隐患做到及时发现，提前防范，确保投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的稳健合规运作。

2、根据基金监管法律法规的相关要求及业务发展变化，优化公司内控和风险管理，更新完善内控制度和业务流程，推动全员全过程风险管理和风险控制责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。

3、注重对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规培训、业务学习等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。今后本基金管理人将继续以“诚信勤勉为投资人服务”为宗旨，不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性，在完善内部控制体系、有效防范风险的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，争取以更好的收益回报基金份额持有人。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会由公司领导、运营部、财务部、权益研究部、固定收益研究部、法律合规部、风险管理部等相关部门工作人员组成。估值委员会成员具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 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，基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末生效未满足三年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

## § 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

报告期内，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、基金合同和托管协议的规定，诚信、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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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

本托管人认真复核了本基金2021年年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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	众环审字(2022)0110468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	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了后附的长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金（以下简称“长江量化消费精选基金”）财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表、2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日期

	<p>间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。我们认为，长江量化消费精选基金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、中国证券投资基金业协会发布的有关规定以及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了长江量化消费精选基金2021年12月31日的财务状况、2021年1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于管理人长江证券（上海）资产管理有限公司，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>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>长江证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“管理人”）对其他信息负责。我们在审计报告日前已获取的其他信息包括长江量化消费精选基金2021年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。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。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。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>管理人负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会、中国证券投资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</p>

	财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
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。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）评价管理人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）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与管理人就计划的审计范围、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	中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	余宝玉	郭和珍
会计师事务所的地址	武汉市武昌区东湖路169号众环大厦	
审计报告日期	2022-03-22	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长江量化消费精选股票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
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	7,923,390.61
结算备付金		455,416.00
存出保证金		18,187.65
交易性金融资产	7.4.7.2	88,232,207.02
其中：股票投资		88,232,207.02
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		93,746.92
应收利息	7.4.7.5	1,051.30
应收股利		-
应收申购款		11,001.98
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		96,735,001.48
<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>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		199,842.38
应付管理人报酬		126,909.83
应付托管费		21,151.64
应付销售服务费		8,518.42
应付交易费用	7.4.7.7	112,637.23
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	200,321.07
负债合计		669,380.57
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	111,328,379.16
未分配利润	7.4.7.10	-15,262,758.25
所有者权益合计		96,065,620.91
负债和所有者权益总计		96,735,001.48

注：（1）报告截止日2021年12月31日，本基金份额总额111,328,379.16份。其中A类基金份额净值0.8637元，基金份额总额92,457,925.75份；C类基金份额净值0.8589元，基金份额总额18,870,453.41份。（2）本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度末数据。

## 7.2 利润表

会计主体：长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2021年01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
<b>一、收入</b>		-13,713,007.11
1. 利息收入		433,961.30
其中：存款利息收入	7.4.7.11	137,971.23

债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		295,990.07
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-14,969,330.85
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-16,101,790.15
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
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	1,132,459.30
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	688,279.50
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	134,082.94
<b>减：二、费用</b>		3,037,255.29
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,721,543.27
2. 托管费	7.4.10.2.2	286,923.78
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	101,155.44
4. 交易费用	7.4.7.18	724,987.20
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.19	202,645.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-16,750,262.40
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-16,750,262.40

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2021年01月27日（基金合同生效日）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）	163,099,531.12	-	163,099,531.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16,750,262.40	-16,750,262.40
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）	-51,771,151.96	1,487,504.15	-50,283,647.81
其中：1. 基金申购款	14,898,483.02	-1,603,241.97	13,295,241.05
2. 基金赎回款	-66,669,634.98	3,090,746.12	-63,578,888.86
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）	111,328,379.16	-15,262,758.25	96,065,620.91

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

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：

周纯

杨忠

何永生

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

长江量化消费精选股票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[2020]2999号文《关于准予长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,由长江证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江量化消费精选股票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,基金存续期限为不定期,首次设立募集资金为163,086,372.65元,认购资金在募集期间产生的利息为13,158.47元,合计为163,099,531.12元,按照每份基金份额面值人民币1.00元计算,折合基金份额为163,099,531.12份,业经中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)众环验字(2021)0100010号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金基金合同》于2021年1月27日正式生效。本基金的基金管理人为长江证券(上海)资产管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江量化消费精选股票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核准或注册上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于80%,其中,投资于符合本基金定义的消费主题相关的上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

本基金的业绩比较基准为:中证全指主要消费指数\*50%+中证全指可选消费指数\*40%+银行活期存款利率(税后)\*10%。

### 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及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会颁布的《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》、中国基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的其他有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 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1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日止期间的财务报表的编制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1月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日止期间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年度，即每年1月1日至12月31日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

当本基金成为金融工具合同条款中的一方时，确认相应的金融资产或金融负债。

基金的金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。其中：摊余成本计量的金融资产包括：货币资金、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产等。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的包括股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资等。以衍生金融工具列示的包括股指期货、国债期货、权证等。

本基金的金融负债主要为以摊余成本计量的金融负债，主要包括卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费等。

#### 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

##### (1) 股票投资

股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。

股票持有期间获得股票股利（包括送红股和公积金转增股本），于除权除息日，按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量，在本账户“数量”栏进行记录。因持有股票而享有的配股权，配股除权日在配股缴款截止日之后的，在除

权日按所配的股数确认未流通部分的股票投资，与已流通部分分别核算。配股除权日在配股缴款截止日之前的，按照权证的有关原则进行核算。

本基金持有股票期间上市公司宣告发放现金股利，于除权除息日，按应收取的现金股利计入投资收益（股利收益）。

卖出股票于交易日确认股票投资收益或投资损失。卖出股票按移动加权平均法逐日结转成本。

### （2）债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本于交易日按债券的公允价值（不含应收利息）入账，按支付价款中包含的应收利息计入“应收利息”科目，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。

配售及认购新发行的分离交易可转债，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于债券部分的成本。

卖出债券于交易日确认债券投资收益（损失）。卖出债券按移动加权平均法逐日结转成本。

### （3）资产支持证券投资

对非货币市场基金，本科目核算资产支持证券投资的实际成本和价值变动（估值增值或减值）；对货币市场基金或中国证监会规定的特定基金品种，本科目核算实际利率摊余成本估算的公允价值。

对非货币市场基金，本科目可按资产支持证券投资的种类，分别“成本”和“估值增值”进行明细核算；对货币市场基金，本科目可按资产支持证券投资的种类，分别“面值”和“折溢价”进行明细核算。

基金取得资产支持证券支付的款项时，应当区分属于资产支持证券投资本金部分和证券投资收益部分。对非货币市场基金，将收到的本金部分冲减本科目（成本），对货币市场基金，将收到的本金部分冲减本科目（面值），并相应结转本科目（折溢价）。将收到的收益部分冲减应计利息（若有）后的差额，记入资产支持证券利息收入。对资产支持证券的付息延期，在确定其付息的可能性仍很大的情况下，可不调整已确认的利息收入。其他与资产支持证券投资相关业务的账务处理比照债券投资。

本科目期末借方余额，反映持有各项资产支持证券投资的公允价值。

### （4）买入返售金融资产

本科目核算按照返售协议约定先买入再按固定价格返售的证券等金融资产所融出的资金。

根据返售协议买入证券等金融资产，按应付或实际支付的金额入账，相关交易费用计入初始成本。于返售日按账面余额结转。

返售前，按实际利率逐日计提利息计入当期损益。

### （5）卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始成本。于回购日按账面余额结转。

(6) 本基金持有的金融资产和金融负债的后续计量与其分类相关联。对于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，按照公允价值后续计量，公允价值变动计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，采用实际利率法，按摊余成本计量。

(7) 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。

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。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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金目前金融资产和金融负债的估值原则和方法如下：

##### (1) 证券交易所上市的有价证券的估值

①交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

②交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

③交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值。

④交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价。

⑤交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值。

⑥对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理

①送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

②首次公开发行未上市的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

③在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(4) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

(5) 持有的银行存款以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

(6) 股指期货合约的估值方法

①评估股指期货合约价值时，应当采用市场公认或者合理的估值方法确定公允价值；

②股指期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(7) 国债期货合约的估值方法

①评估国债期货合约价值时，应当采用市场公认或者合理的估值方法确定公允价值；

②国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(8) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值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，按最能反映公允价值的方法估值。

(9) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵消。但是同时满足下列条件时，以相互抵消后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵消已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的。
- (2) 本基金以净额结算，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的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

(6) 债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具投资收益于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2) 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(3) 本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.60%。C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.60%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金利润的构成：基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

(2) 基金可供分配利润：基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

##### (3) 基金收益分配原则

①本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对A类、C类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择红利再投资的，基金份额的现金红利将按除息后的基金份额净值折算成相应类别的基金份额，红利再投资的A类基金份额免收申购费。

②基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

③本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权。

④法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整。

(4) 收益分配方案：基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 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和债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) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(2) 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，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征增值税；公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

(3) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

(5) 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，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

(6) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体、纳税义务按上述税收法律法规执行。

## 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

活期存款	7,923,390.61
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	7,923,390.61

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度末数据。

#### 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	87,543,927.52	88,232,207.02	688,279.50
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	87,543,927.52	88,232,207.02	688,279.50

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度末数据。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	816.89
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	225.39
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	9.02
合计	1,051.30

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度末数据。

**7.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产余额。

**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
交易所市场应付交易费用	112,637.23

银行间市场应付交易费用	-
合计	112,637.23

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度末数据。

#### 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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	321.07
应付证券出借违约金	-
预提费用	200,000.00
合计	200,321.07

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度末数据。

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 长江量化消费精选A

金额单位：人民币元

项目 (长江量化消费精选A)	本期 2021年01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	142,104,702.43	142,104,702.43
本期申购	5,757,505.68	5,757,505.68
本期赎回（以“-”号填列）	-55,404,282.36	-55,404,282.36
本期末	92,457,925.75	92,457,925.75

##### 7.4.7.9.2 长江量化消费精选C

金额单位：人民币元

项目 (长江量化消费精选C)	本期 2021年01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
-------------------	--

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	20,994,828.69	20,994,828.69
本期申购	9,140,977.34	9,140,977.34
本期赎回（以“-”号填列）	-11,265,352.62	-11,265,352.62
本期末	18,870,453.41	18,870,453.41

注：本基金募集期间有效净认购资金合计为人民币 163,086,372.65 元，折合为基金份额共计 163,086,372.65 份（其中 A 类份额 142,092,735.07 份，C 类份额 20,993,637.58 份）。有效净认购资金于募集期间产生的利息为人民币 13,158.47 元，折合为基金份额 13,158.47 份（其中 A 类份额 11,967.36 份，C 类份额 1,191.11 份），已计入基金份额持有人账户。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 长江量化消费精选A

单位：人民币元

项目 (长江量化消费精选A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-14,578,862.87	336,540.31	-14,242,322.56
本期基金份额交易产生的变动数	1,596,625.01	44,931.87	1,641,556.88
其中：基金申购款	-453,948.51	-255,766.94	-709,715.45
基金赎回款	2,050,573.52	300,698.81	2,351,272.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,982,237.86	381,472.18	-12,600,765.68

##### 7.4.7.10.2 长江量化消费精选C

单位：人民币元

项目 (长江量化消费精选C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,859,679.03	351,739.19	-2,507,939.84
本期基金份额交易产生的变动数	122,390.22	-276,442.95	-154,052.73

其中：基金申购款	-538,046.70	-355,479.82	-893,526.52
基金赎回款	660,436.92	79,036.87	739,473.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,737,288.81	75,296.24	-2,661,992.57

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	116,096.08
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	21,544.56
其他	330.59
合计	137,971.23

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	246,035,941.31
减：卖出股票成本总额	262,137,731.46
买卖股票差价收入	-16,101,790.15

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益——买卖债券差价收入。

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.14 衍生工具收益****7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,132,459.30
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	1,132,459.30

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

**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01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	688,279.50

——股票投资	688,279.50
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	688,279.50

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	134,082.94
合计	134,082.94

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	724,987.20
银行间市场交易费用	-
合计	724,987.20

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	80,000.00
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,245.60
开户费	400.00
合计	202,645.60

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

#### 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，本基金无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金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
长江证券（上海）资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长江证券	591,816,182.18	100.00%

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

## 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
长江证券	2,429,000,000.00	100.00%

注：本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

## 7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	424,597.87	100.00%	112,637.23	100.00%

注：（1）上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示，交易佣金的计算方式、佣金计算比率公允。（2）该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提

供的证券投资研究成果和市场信息服务等。(3) 本基金基金合同生效日为2021年1月27日, 截至本报告期末未满一年, 无上年度可比期间数据。

#### 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01月27日 (基金合同生效日) 至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1, 721, 543. 27
其中: 支付销售机构的客户维护费	788, 481. 64

注: (1) 本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

(2) 基金管理费每日计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

(3) 本基金基金合同生效日为2021年1月27日, 截至本报告期末未满一年, 无上年度可比期间数据。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期
	2021年01月27日 (基金合同生效日) 至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	286, 923. 78

注: (1) 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

(2) 基金托管费每日计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托

管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

(3) 本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长江量化消费精选A	长江量化消费精选C	合计
长江证券股份有限公司	0.00	11,917.98	11,917.98
长江证券（上海）资产管理有限公司	0.00	51,190.19	51,190.19
兴业银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	63,108.17	63,108.17

注：（1）本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.60%。本基金销售服务费将专门用于本基金C类基金份额的销售与基金份额持有人服务。C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.60%年费率计提。C类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times \text{销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

(2) 销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

(3) 本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

#### 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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期未发生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。

**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**

本基金本报告期未发生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。

**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**

## 长江量化消费精选C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月27日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
基金合同生效日（2021年01月27日）持有的基金份额	10,000,680.56
报告期初持有的基金份额	-
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	10,000,680.56
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	53.00%

注：（1）本基金管理人于募集期内运用固有资金认购本基金C类份额，适用认购费率0；

（2）报告期期末持有的基金份额占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额总额；（3）本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

**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**

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

## 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01月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	7,923,390.61	116,096.08

注：（1）上述银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按约定利率计息。

（2）本基金基金合同生效日为2021年1月27日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末进行利润分配。

## 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
601728	中国电信	2021-08-11	2022-02-21	新股流通受限	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688778	厦钨新能	2021-07-29	2022-02-07	科创板打新限售	24.50	100.48	1,015	24,867.50	101,987.20	-

001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
--------	-----	------------	------------	-------	-------	-------	-----	----------	----------	---

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金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

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0元，无质押债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0元，无质押债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金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

本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险控制委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由法律合规部、风险管理部负责，组织、协调并与各业务部门共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险控制委员会报告公司风险状况。法律合规部和风险管理部分别由合规总监和首席风险官分管，配置有合规、风控方面专业人员。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是

通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。

本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金运作周期内的每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性置项流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风

险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券均在证券交易所上市，持有资产流动性高，本基金可通过卖出资产方式应对流动性需求。本基金管理人每日预测本基金的流动性管理，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的检测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 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现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 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年以内	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,923,390.61	-	-	-	7,923,390.61
结算备付金	455,416.00	-	-	-	455,416.00
存出保证金	18,187.65	-	-	-	18,187.65
交易性金融资产	-	-	-	88,232,207.02	88,232,207.02
应收证券清算款	-	-	-	93,746.92	93,746.92
应收利息	-	-	-	1,051.30	1,051.30
应收申购款	-	-	-	11,001.98	11,001.98
资产总计	8,396,994.26	-	-	88,338,007.22	96,735,001.48
负债					

应付赎回款	-	-	-	199,842.38	199,842.38
应付管理人报酬	-	-	-	126,909.83	126,909.83
应付托管费	-	-	-	21,151.64	21,151.64
应付销售服务费	-	-	-	8,518.42	8,518.42
应付交易费用	-	-	-	112,637.23	112,637.23
其他负债	-	-	-	200,321.07	200,321.07
负债总计	-	-	-	669,380.57	669,380.57
利率敏感度缺口	8,396,994.26	-	-	87,668,626.65	96,065,620.91

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

2021年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所及银行间同业市场交易的股票和固定收益品种，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种方法对基金进行风险度量，以及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	88,232,207.02	91.85
交易性金融资产—基金投资	-	-

交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	88,232,207.02	91.85

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变。	
	以下分析中，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)
		本期末 2021年12月31日
	业绩比较基准上涨5%	3,957,781.30
	业绩比较基准下跌5%	-3,957,781.30

注：（1）上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，组合业绩比较基准发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响；（2）本基金基金合同于2021年1月27日生效，截至本报告期末未满一年，无上年度末数据。

#### 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86,442,288.36元，属于第二层次的余额为1,789,918.66元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	88,232,207.02	91.21
	其中：股票	88,232,207.02	91.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,378,806.61	8.66
8	其他各项资产	123,987.85	0.13

9	合计	96,735,001.48	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

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	6,960,842.00	7.25
B	采矿业	-	-
C	制造业	73,950,656.05	76.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	193,006.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,682,426.97	1.75
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,445,276.00	5.67
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	88,232,207.02	91.85

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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	600887	伊利股份	100,200	4,154,292.00	4.32
2	002714	牧原股份	77,500	4,135,400.00	4.30
3	000568	泸州老窖	15,700	3,985,759.00	4.15
4	603589	口子窖	55,300	3,919,111.00	4.08
5	603198	迎驾贡酒	53,700	3,729,465.00	3.88
6	600809	山西汾酒	11,720	3,700,941.60	3.85
7	000858	五粮液	16,579	3,691,480.14	3.84
8	600519	贵州茅台	1,800	3,690,000.00	3.84
9	603288	海天味业	34,990	3,677,798.90	3.83
10	603369	今世缘	65,200	3,546,880.00	3.69
11	000596	古井贡酒	14,400	3,513,600.00	3.66
12	000799	酒鬼酒	16,100	3,421,250.00	3.56
13	600779	水井坊	25,200	3,023,748.00	3.15
14	002027	分众传媒	367,500	3,009,825.00	3.13
15	300498	温氏股份	146,700	2,825,442.00	2.94
16	600690	海尔智家	86,100	2,573,529.00	2.68
17	000333	美的集团	34,500	2,546,445.00	2.65
18	601888	中国中免	11,100	2,435,451.00	2.54
19	600104	上汽集团	117,300	2,419,899.00	2.52
20	600660	福耀玻璃	50,700	2,389,998.00	2.49
21	000651	格力电器	61,000	2,258,830.00	2.35
22	002311	海大集团	30,000	2,199,000.00	2.29
23	002594	比亚迪	7,600	2,037,712.00	2.12
24	000625	长安汽车	133,400	2,026,346.00	2.11
25	601633	长城汽车	38,500	1,868,790.00	1.95
26	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	1.75
27	000895	双汇发展	52,100	1,643,755.00	1.71
28	600132	重庆啤酒	10,700	1,619,124.00	1.69
29	000876	新希望	88,900	1,352,169.00	1.41

30	600600	青岛啤酒	13,600	1,346,400.00	1.40
31	601952	苏垦农发	42,500	506,175.00	0.53
32	603043	广州酒家	20,700	498,042.00	0.52
33	603605	珀莱雅	1,700	354,127.00	0.37
34	002832	比音勒芬	13,140	334,413.00	0.35
35	603195	公牛集团	1,300	217,490.00	0.23
36	002293	罗莱生活	14,700	210,651.00	0.22
37	600559	老白干酒	6,900	192,786.00	0.20
38	300138	晨光生物	11,100	185,370.00	0.19
39	002003	伟星股份	13,700	175,634.00	0.18
40	002304	洋河股份	900	148,257.00	0.15
41	002677	浙江美大	7,900	137,065.00	0.14
42	300894	火星人	2,700	132,759.00	0.14
43	300783	三只松鼠	3,100	120,807.00	0.13
44	603610	麒盛科技	4,340	112,232.40	0.12
45	688778	厦钨新能	1,015	101,987.20	0.11
46	002385	大北农	8,800	92,312.00	0.10
47	300915	海融科技	1,300	74,373.00	0.08
48	603719	良品铺子	1,700	72,199.00	0.08
49	600873	梅花生物	8,300	63,661.00	0.07
50	603156	养元饮品	1,852	52,615.32	0.05
51	300999	金龙鱼	300	18,879.00	0.02
52	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.01

#### 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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	13,054,390.00	13.59
2	000799	酒鬼酒	10,249,020.00	10.67
3	601888	中国中免	9,700,749.00	10.10

4	002714	牧原股份	9,635,693.71	10.03
5	002304	洋河股份	9,547,285.00	9.94
6	603198	迎驾贡酒	9,347,231.00	9.73
7	000858	五 粮 液	9,060,847.13	9.43
8	600779	水井坊	8,822,893.00	9.18
9	000568	泸州老窖	8,173,357.00	8.51
10	002568	百润股份	7,975,654.60	8.30
11	600809	山西汾酒	7,966,806.00	8.29
12	600660	福耀玻璃	7,942,830.00	8.27
13	603288	海天味业	7,848,838.00	8.17
14	600887	伊利股份	7,281,898.00	7.58
15	600132	重庆啤酒	7,244,039.42	7.54
16	603369	今世缘	6,625,793.00	6.90
17	000596	古井贡酒	6,187,833.00	6.44
18	000651	格力电器	5,726,316.00	5.96
19	000333	美的集团	5,533,097.00	5.76
20	300783	三只松鼠	5,159,846.00	5.37
21	000848	承德露露	5,060,416.00	5.27
22	603919	金徽酒	4,814,497.80	5.01
23	600690	海尔智家	4,787,336.00	4.98
24	603156	养元饮品	4,642,143.12	4.83
25	002027	分众传媒	4,528,414.00	4.71
26	300413	芒果超媒	4,427,860.00	4.61
27	002594	比亚迪	4,253,427.00	4.43
28	603043	广州酒家	4,228,920.40	4.40
29	603589	口子窖	4,110,616.00	4.28
30	002311	海大集团	4,071,697.00	4.24
31	603605	珀莱雅	4,043,467.00	4.21
32	002867	周大生	4,009,723.00	4.17
33	002832	比音勒芬	3,941,984.80	4.10
34	002293	罗莱生活	3,920,032.00	4.08

35	603489	八方股份	3,836,682.00	3.99
36	002458	益生股份	3,751,622.30	3.91
37	603195	公牛集团	3,396,423.25	3.54
38	603833	欧派家居	3,366,919.04	3.50
39	603345	安井食品	3,243,908.00	3.38
40	002508	老板电器	3,135,835.00	3.26
41	000895	双汇发展	2,853,516.00	2.97
42	002511	中顺洁柔	2,823,929.00	2.94
43	002032	苏泊尔	2,784,358.80	2.90
44	000625	长安汽车	2,665,071.00	2.77
45	300146	汤臣倍健	2,622,835.00	2.73
46	002003	伟星股份	2,571,541.46	2.68
47	000785	居然之家	2,571,538.00	2.68
48	601728	中国电信	2,549,814.69	2.65
49	600104	上汽集团	2,546,193.00	2.65
50	603197	保隆科技	2,540,151.42	2.64
51	300498	温氏股份	2,474,430.77	2.58
52	601633	长城汽车	2,465,745.00	2.57
53	601799	星宇股份	2,410,218.00	2.51
54	603486	科沃斯	2,399,969.00	2.50
55	600873	梅花生物	2,276,575.00	2.37
56	002563	森马服饰	2,060,022.00	2.14
57	002847	盐津铺子	2,005,058.10	2.09

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；（2）本项“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002304	洋河股份	8,792,881.00	9.15

2	603198	迎驾贡酒	8,291,949.40	8.63
3	600519	贵州茅台	8,181,921.00	8.52
4	601888	中国中免	7,213,052.00	7.51
5	002568	百润股份	6,890,311.00	7.17
6	000799	酒鬼酒	6,648,786.90	6.92
7	600132	重庆啤酒	5,604,531.00	5.83
8	600660	福耀玻璃	5,409,052.00	5.63
9	600809	山西汾酒	4,836,796.00	5.03
10	600779	水井坊	4,628,749.00	4.82
11	603156	养元饮品	4,436,678.00	4.62
12	000848	承德露露	4,394,802.50	4.57
13	300783	三只松鼠	4,369,330.00	4.55
14	002714	牧原股份	4,209,031.93	4.38
15	603605	珀莱雅	4,163,456.00	4.33
16	002458	益生股份	4,090,530.40	4.26
17	002867	周大生	3,987,680.70	4.15
18	000858	五粮液	3,984,787.00	4.15
19	000568	泸州老窖	3,984,400.00	4.15
20	603919	金徽酒	3,898,754.70	4.06
21	603489	八方股份	3,794,793.74	3.95
22	300413	芒果超媒	3,692,968.00	3.84
23	002832	比音勒芬	3,651,622.00	3.80
24	603288	海天味业	3,538,468.40	3.68
25	002293	罗莱生活	3,291,205.00	3.43
26	603043	广州酒家	3,197,763.10	3.33
27	002508	老板电器	3,088,726.00	3.22
28	000596	古井贡酒	3,043,827.00	3.17
29	603833	欧派家居	2,930,576.20	3.05
30	000651	格力电器	2,929,016.00	3.05
31	002003	伟星股份	2,862,631.00	2.98
32	603369	今世缘	2,836,496.00	2.95

33	600887	伊利股份	2,766,358.00	2.88
34	603195	公牛集团	2,763,132.00	2.88
35	300146	汤臣倍健	2,754,048.00	2.87
36	000785	居然之家	2,729,663.00	2.84
37	601799	星宇股份	2,715,823.00	2.83
38	603345	安井食品	2,540,028.00	2.64
39	000333	美的集团	2,515,647.00	2.62
40	002032	苏泊尔	2,479,889.00	2.58
41	603197	保隆科技	2,379,645.71	2.48
42	603486	科沃斯	2,233,134.00	2.32
43	600873	梅花生物	2,132,738.00	2.22
44	600690	海尔智家	2,112,936.00	2.20

注：（1）卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。（2）本项“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	349,681,658.98
卖出股票收入（成交）总额	246,035,941.31

注：（1）买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。（2）“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

## 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

本基金本着审慎性原则、在风险可控的前提下，以套期保值策略为目的，适度参与国债期货的投资。

### 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。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票，没有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	18,187.65
2	应收证券清算款	93,746.92
3	应收股利	-
4	应收利息	1,051.30
5	应收申购款	11,001.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	123,987.85

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §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

份额 级别	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
长江	1,677	55,132.93	2,310,561.20	2.50%	90,147,364.55	97.50%

量化消费精选A						
长江量化消费精选C	1,882	10,026.81	10,000,913.09	53.00%	8,869,540.32	47.00%
合计	3,487	31,926.69	12,311,474.29	11.06%	99,016,904.87	88.94%

注：（1）分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

（2）户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长江量化消费精选A	229,221.72	0.25%
	长江量化消费精选C	0.00	0.00%
	合计	229,221.72	0.21%

注：持有份额总数占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长江量化消费精选A	0~10
	长江量化消费精选C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长江量化消费精选A	0~10
	长江量化消费精选C	0
	合计	0~10

## 9.4 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	10,000,680.56	8.98%	10,000,680.56	8.98%	3年
基金管理人高级 管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,680.56	8.98%	10,000,680.56	8.98%	-

注：持有份额占基金总份额比例、发起份额占基金总份额比例的计算中，分母采用报告期末基金份额总额。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	长江量化消费精选A	长江量化消费精选C
基金合同生效日(2021年01月27日)基金份额总额	142,104,702.43	20,994,828.69
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,757,505.68	9,140,977.34
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	55,404,282.36	11,265,352.62
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	92,457,925.75	18,870,453.41

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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

1、本报告期内，自2021年1月22日起，吴迪先生担任本基金管理人首席风险官；董来富先生离任本基金管理人副总经理、首席风险官；范海蓉女士离任本基金管理人副总经理。

2、本报告期内，自2021年4月20日起，杨忠先生担任本基金管理人总经理；唐吟波女士离任本基金管理人总经理。

3、本报告期内，自2021年12月27日起，谷松女士离任本基金管理人副总经理。

4、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理和基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为80,000.00元人民币。本基金本报告期内继续选聘中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，该审计机构自基金合同生效日起为本基金提供审计服务。

## 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

1、本报告期内，中国证券监督管理委员会对本基金管理人采取责令改正的监管措施，并对相关高级管理人员采取监管谈话措施。截至本报告披露日，本基金管理人已按要求完成整改。

2、本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

## 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	
长江证券	2	591,816,182.18	100.00%	424,597.87	100.00%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于2亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金公司进行证券交易的需要，并能为基金公司提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

我司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象，并签订交易单元租用协议。公司的投资和研究部门定期对所选证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供宏观、行业、策略、专题、公司等研究报告的质量和数量；组织相关研讨会议的数量和质量；协助安排上市公司调研的质量和数量；主动进行上门路演和反路演的数量和质量；以及其他及时性及提供研究服务主动性和质量等情况。最终公司统一依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。

3、本报告期内，本基金新增租用上海、深圳证券交易所交易单元各1个。

### 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	
	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
长江证券	-	-	2,429,000,000.00	100.00%

### 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	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金基金份额发售公告	规定报刊、网站	2021-01-06
2	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要	规定网站	2021-01-06
3	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要	规定网站	2021-01-06

4	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金招募说明书	规定网站	2021-01-06
5	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金基金合同	规定网站	2021-01-06
6	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金托管协议	规定网站	2021-01-06
7	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	规定报刊	2021-01-06
8	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2021-01-23
9	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2021-01-23
10	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金基金合同生效公告	规定报刊、网站	2021-01-28
11	长江证券（上海）资产管理有限公司关于公司董事变更的公告	规定报刊、网站	2021-03-17
12	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告	规定报刊、网站	2021-04-07
13	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2021-04-21
14	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金2021年第一季度报告	规定网站	2021-04-22
15	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金2021年第一季度报告提示性公告	规定报刊	2021-04-22
16	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上交易系统升级维护的公告	规定报刊、网站	2021-04-27
17	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金基金经理变更公告	规定报刊、网站	2021-05-11
18	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2021-05-13
19	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2021-05-13

20	长江量化消费精选长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2021年5月13日更新）	规定网站	2021-05-13
21	长江证券（上海）资产管理有限公司关于开展网上服务系统应急演练的公告	规定报刊、网站	2021-05-20
22	长江证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金参加上海基煜基金销售有限公司费率优惠活动的公告	规定报刊、网站	2021-07-07
23	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上服务系统升级维护的公告	规定报刊、网站	2021-07-15
24	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金2021年第二季度报告	规定网站	2021-07-21
25	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金2021年第二季度报告提示性公告	规定报刊	2021-07-21
26	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上服务系统升级维护的公告	规定报刊、网站	2021-07-30
27	长江证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金参加中天证券股份有限公司基金定期定额投资费率优惠活动的公告	规定报刊、网站	2021-08-30
28	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金2021年中期报告	规定网站	2021-08-30
29	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金2020年中期报告提示性公告	规定报刊	2021-08-30
30	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上交易系统暂停服务的公告	规定报刊、网站	2021-10-14
31	长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金2021年第三季度报告	规定网站	2021-10-27
32	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金2021年第三季度报告提示性公告	规定报刊	2021-10-27
33	长江证券（上海）资产管理有限公司关于开展网上服务系统应急演练的公告	规定报刊、网站	2021-11-11
34	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上服务系统升级维护的公告	规定报刊、网站	2021-12-02

35	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上交易系统升级维护的公告	规定报刊、网站	2021-12-13
36	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2021-12-29

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金募集申请的注册文件
- 2、长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金基金合同
- 3、长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金招募说明书
- 4、长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金托管协议
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 12.2 存放地点

存放地点为基金管理人办公地址：上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公地点免费查阅，亦可通过基金管理人网站查阅，网址为www.cjzcg1.com。

长江证券（上海）资产管理有限公司  
二〇二二年三月三十一日