

# 景顺长城量化港股通股票型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>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 主要财务指标和基金净值表现</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 .....	7
3.3 其他指标 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	11
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 .....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	14
6.4 报表附注 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	41

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.12 投资组合报告附注 .....	42
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	48
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化港股通股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城量化港股通股票
基金主代码	006106
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 19 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	40,484,793.78 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过量化模型精选股票，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要包括：</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。本基金的量化投资主要依据基本面投资原则构建投资组合，控制对市场的冲击，而非单一趋势性交易或程序化交易。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p> <p>4、股指期货、国债期货投资策略</p> <p>本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。</p> <p>5、中小企业私募债券的投资策略</p> <p>对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金将加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、</p>

	<p>行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽的调研和分析。</p> <p>6、资产支持证券的投资策略</p> <p>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，考虑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>
业绩比较基准	中证港股通综合指数收益率*85%+银行活期存款利率(税后)*15%
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，属于证券投资基金中风险程度较高的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。</p> <p>本基金还可在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	郭明
	联系电话	0755-82370388	(010) 66105799
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755-22381339	(010) 66105798
注册地址		深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		李进	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	-926,666.08
本期利润	60,426.85
加权平均基金份额本期利润	0.0014
本期加权平均净值利润率	0.16%
本期基金份额净值增长率	-1.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	-4,788,062.11
期末可供分配基金份额利润	-0.1183
期末基金资产净值	35,696,731.67
期末基金份额净值	0.8817
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-11.83%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

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

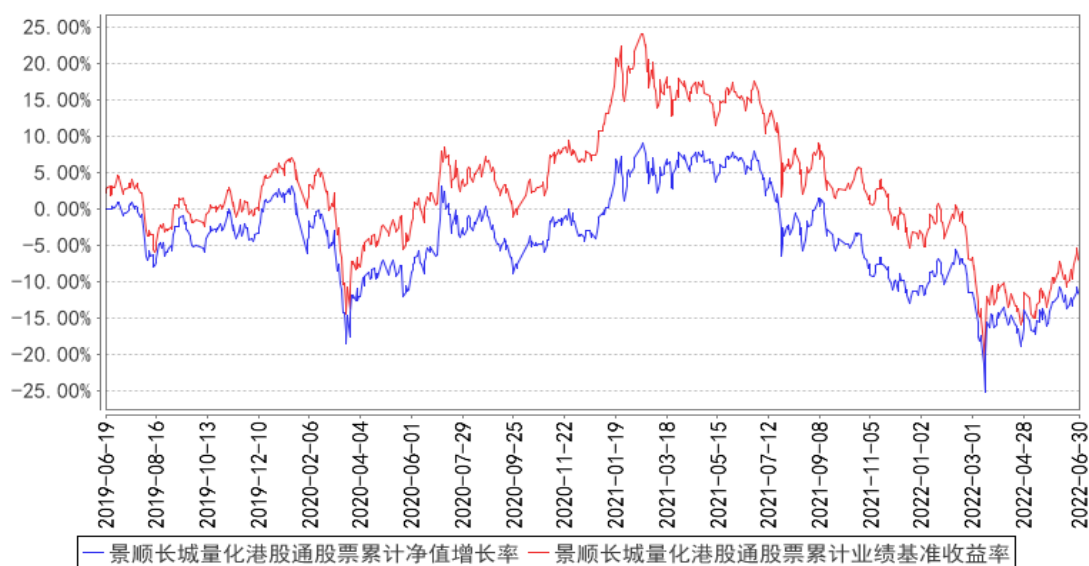
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.05%	0.94%	2.51%	1.19%	-1.46%	-0.25%
过去三个月	3.68%	1.21%	4.71%	1.29%	-1.03%	-0.08%
过去六个月	-1.36%	1.51%	-4.34%	1.67%	2.98%	-0.16%
过去一年	-17.29%	1.30%	-20.05%	1.40%	2.76%	-0.10%
过去三年	-12.02%	1.21%	-9.95%	1.23%	-2.07%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-11.83%	1.20%	-7.24%	1.22%	-4.59%	-0.02%

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

景顺长城量化港股通股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：本基金投资组合中投资于港股通标的股票的比例不低于基金资产的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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自2019年6月19日基金合同生效日起6个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。自2019年9月6日，本基金的业绩比较基准由“中证港股通综合指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%”调整为“中证港股通综合指数收益率\*85%+银行活期存款利率(税后)\*15%”。

### 3.3 其他指标

无。

## §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 2022 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 150 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周春泉	本基金的基金经理	2021 年 1 月 7 日	-	10 年	管理学博士，CFA。曾任海通国际证券集团资产管理部量化分析师、股票衍生品部量化分析师、资产管理部分析师，中泰金融国际有限公司资产管理部副总裁、基金经理。2018 年 10 月加入本公司，担任专户投资部投资经理，自 2021 年 1 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 10 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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城量化港股通股票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基金和投资组合。

#### 4.3.2 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 27 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

2022 年上半年，俄乌冲突、美联储加息、新冠疫情等因素引发全球资本市场的风险偏好下行。随着国内疫情逐步得到控制，稳增长政策的不断加码，消费和出行需求复苏，经济逐步回暖。整体而言，国内货币政策总体保持稳健，流动性充裕，宏观环境总体温和，经济呈现出弱复苏的态势。上半年港股市场波动，恒生指数、国企指数、恒生科技、港股通综指分别下跌 6.57%、6.91%、14.12%和 9.39%；4 月末以来市场风险偏好有所提升。

本基金主要以基本面量化选股为主，同时不断寻找新的有用信息。风格上维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生长稳健的公司，在股市波动中通过自下而上选股以期产生持续稳定的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2022 年上半年，本基金份额净值增长率为-1.36%，业绩比较基准收益率为-4.34%。

### 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 年下半年，海外方面，俄乌冲突、美联储加息对国内资本市场的边际影响明显降低。国内方面，我们对宏观场景的判断倾向于“宽货币、宽信用”，随着稳增长政策效应的逐步显现，盈利下行周期进入末段。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。科技、医疗、电新等行业近年来在港股占比显著上升，一些头部公司计划以港交所为主要上市地，将进一步优化港股通的股票池。目前港股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人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及适用性的情况时，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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

从 2021 年 10 月 26 日至 2022 年 1 月 10 日，从 2022 年 1 月 18 日至 2022 年 4 月 7 日，从 2022 年 4 月 14 日至 2022 年 6 月 30 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他

法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城量化港股通股票型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,880,220.51	6,992,600.80
结算备付金		1.56	-
存出保证金		123,370.51	49,027.67
交易性金融资产	6.4.7.2	30,432,064.17	37,125,583.24
其中：股票投资		30,432,064.17	37,125,583.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-

应收清算款		-	-
应收股利		453,595.43	31,330.67
应收申购款		2,234.09	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	690.60
资产总计		35,891,486.27	44,199,232.98
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		6.68	7.96
应付赎回款		25,082.27	62,533.49
应付管理人报酬		43,679.16	55,320.44
应付托管费		7,279.88	9,220.07
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	118,706.61	145,046.88
负债合计		194,754.60	272,128.84
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	40,484,793.78	49,139,745.87
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-4,788,062.11	-5,212,641.73
净资产合计		35,696,731.67	43,927,104.14
负债和净资产总计		35,891,486.27	44,199,232.98

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8817 元，基金份额总额 40,484,793.78 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化港股通股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		468,840.56	4,460,006.46
1. 利息收入		13,590.94	12,471.15

其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,590.94	12,471.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-762,807.78	3,789,575.21
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,630,403.84	3,097,037.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	384.51
股利收益	6.4.7.13	867,596.06	692,153.32
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	987,092.93	578,411.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	230,964.47	79,548.15
<b>减：二、营业总支出</b>		408,413.71	669,576.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	285,042.55	352,595.62
2. 托管费	6.4.10.2.2	47,507.13	58,765.89
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	1.39
8. 其他费用	6.4.7.16	75,864.03	258,213.77
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		60,426.85	3,790,429.79
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		60,426.85	3,790,429.79
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		60,426.85	3,790,429.79

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城量化港股通股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	49,139,745.87	-	-5,212,641.73	43,927,104.14
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	49,139,745.87	-	-5,212,641.73	43,927,104.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,654,952.09	-	424,579.62	-8,230,372.47
（一）、综合收益总额	-	-	60,426.85	60,426.85
（二）、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）	-8,654,952.09	-	364,152.77	-8,290,799.32
其中：1. 基金申购款	38,306,540.48	-	-4,782,093.33	33,524,447.15
2. 基金赎回款	-46,961,492.57	-	5,146,246.10	-41,815,246.47
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	40,484,793.78	-	-4,788,062.11	35,696,731.67
项目	上年度可比期间			
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	52,391,535.74	-	-569,824.51	51,821,711.23
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	52,391,535.74	-	-569,824.51	51,821,711.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-13,647,333.86	-	3,127,916.91	-10,519,416.95
（一）、综合收益总额	-	-	3,790,429.79	3,790,429.79
（二）、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）	-13,647,333.86	-	-662,512.88	-14,309,846.74
其中：1. 基金申购款	15,706,537.79	-	843,522.45	16,550,060.24
2. 基金赎回款	-29,353,871.65	-	-1,506,035.33	-30,859,906.98

(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	38,744,201.88	-	2,558,092.40	41,302,294.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>康乐</u>	<u>吴建军</u>	<u>邵媛媛</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城量化港股通股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]第 946 号《关于准予景顺长城量化港股通股票型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2018]3114 号《关于景顺长城量化港股通股票型证券投资基金延期募集备案的回函》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化港股通股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 222,207,070.19 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0316 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城量化港股通股票型证券投资基金基金合同》于 2019 年 6 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 222,337,194.36 份基金份额,其中认购资金利息折合 130,124.17 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化港股通股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括境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上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债等)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规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)。本基金投资组合中投资于港股通标的股票的比例不低于基金资产的 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要缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府证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。权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。根据《景顺长城基金管理有限公司关于调整景顺长城量化港股通股票型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同的公告》，本基金的业绩比较基准自 2019 年 9 月 6 日起变更为：中证港股通综合指数收益率 X85%+银行活期存款利率(税后)X15%。本基金的原业绩比较基准为：中证港股通综合指数收益率 X95%+银行活期存款利率(税后)X5%。

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 8 月 29 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

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

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.3 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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代

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投资收益。

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

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

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度可比期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收股利，金额分别为 6,992,600.80 元、0.00 元、49,027.67 元、690.60 元和 31,330.67 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收股利，金额分别为 6,993,284.15 元、7.25 元、49,027.67 元、0.00 元和 31,330.67 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 37,125,583.24 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 37,125,583.24 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 7.96 元、62,533.49 元、55,320.44 元、9,220.07 元、64,996.04 元和 50.84 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 7.96 元、62,533.49 元、55,320.44 元、9,220.07 元、64,996.04 元和 50.84 元。

于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产

品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日

活期存款	4,880,220.51
等于：本金	4,879,781.99
加：应计利息	438.52
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1 个月（含）-3 个月	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,880,220.51

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	30,693,562.72	-	30,432,064.17	-261,498.55
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	30,693,562.72	-	30,432,064.17	-261,498.55

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末从买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	26.30
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	44,296.55
其中：交易所市场	44,296.55
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	74,383.76
合计	118,706.61

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	49,139,745.87	49,139,745.87
本期申购	38,306,540.48	38,306,540.48
本期赎回（以“-”号填列）	-46,961,492.57	-46,961,492.57
本期末	40,484,793.78	40,484,793.78

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.8 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
本期期初	-1,352,460.08	-3,860,181.65	-5,212,641.73
本期利润	-926,666.08	987,092.93	60,426.85
本期基金份额交易产生的变动数	286,644.19	77,508.58	364,152.77
其中：基金申购款	-1,514,079.62	-3,268,013.71	-4,782,093.33
基金赎回款	1,800,723.81	3,345,522.29	5,146,246.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,992,481.97	-2,795,580.14	-4,788,062.11

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	11,637.42
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	1,146.01



其他	807.51
合计	13,590.94

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	66,735,661.17
减：卖出股票成本总额	68,042,855.20
减：交易费用	323,209.81
买卖股票差价收入	-1,630,403.84

#### 6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	867,596.06
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	867,596.06

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	987,092.93
股票投资	987,092.93
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	987,092.93

## 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	230,964.47
合计	230,964.47

## 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	189.00
证券组合费	1,291.27
合计	75,864.03

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
长城证券	8,875,545.24	6.99	4,817,481.17	5.88

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	7,100.67	6.99	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	3,854.22	5.88	3,854.22	14.25

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	285,042.55	352,595.62
其中：支付销售机构的客户维护费	49,301.82	74,046.37

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	47,507.13	58,765.89

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期	4,880,220.51	11,637.42	5,998,756.18	11,502.95

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
00813	世茂集团	2022 年 4 月 1 日	重大事项 停牌	3.78	-	-	12,500	46,285.34	47,249.25	-
03333	中国恒大	2022 年 3 月 21 日	重大事项 停牌	1.41	-	-	20,000	26,949.96	28,221.27	-
03380	龙光集团	2022 年 5 月 12 日	重大事项 停牌	1.86	2022 年 8 月 24 日	0.82	25,000	76,814.76	46,607.86	-

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人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。

### 6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券（上年度末：同）。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 6.4.12。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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,880,220.51	-	-	-	-	-	4,880,220.51
结算备付金	1.56	-	-	-	-	-	1.56
存出保证金	123,370.51	-	-	-	-	-	123,370.51
交易性金融资产	-	-	-	-	-	30,432,064.17	30,432,064.17
应收股利	-	-	-	-	-	453,595.43	453,595.43
应收申购款	-	-	-	-	-	2,234.09	2,234.09
资产总计	5,003,592.58	-	-	-	-	30,887,893.69	35,891,486.27
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	25,082.27	25,082.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	43,679.16	43,679.16
应付托管费	-	-	-	-	-	7,279.88	7,279.88
应付证券清算款	-	-	-	-	-	6.68	6.68
其他负债	-	-	-	-	-	118,706.61	118,706.61
负债总计	-	-	-	-	-	194,754.60	194,754.60
利率敏感度缺口	5,003,592.58	-	-	-	-	-	-
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,992,600.80	-	-	-	-	-	6,992,600.80
存出保证金	49,027.67	-	-	-	-	-	49,027.67
交易性金融资产	-	-	-	-	-	37,125,583.24	37,125,583.24
应收利息	-	-	-	-	-	690.60	690.60
应收股利	-	-	-	-	-	31,330.67	31,330.67
资产总计	7,041,628.47	-	-	-	-	37,157,604.51	44,199,232.98
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	62,533.49	62,533.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	55,320.44	55,320.44
应付托管费	-	-	-	-	-	9,220.07	9,220.07
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7.96	7.96
应付交易费用	-	-	-	-	-	64,996.04	64,996.04
其他负债	-	-	-	-	-	80,050.84	80,050.84
负债总计	-	-	-	-	-	272,128.84	272,128.84
利率敏感度缺口	7,041,628.47	-	-	-	-	-	-

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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



#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	30,432,064.17	-	30,432,064.17
资产合计	-	30,432,064.17	-	30,432,064.17
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	30,432,064.17	-	30,432,064.17
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	37,125,583.24	-	37,125,583.24
资产合计	-	37,125,583.24	-	37,125,583.24
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	37,125,583.24	-	37,125,583.24

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	1,521,603.21	1,856,279.16
	所有外币相对人民币贬值 5%	-1,521,603.21	-1,856,279.16

#### 6.4.13.4.3 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：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	30,432,064.17	85.25	37,125,583.24	84.52
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	30,432,064.17	85.25	37,125,583.24	84.52

##### 6.4.13.4.3.2 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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	沪深 300 指数上升 5%	1,077,661.96	1,442,052.78
	沪深 300 指数下降 5%	-1,077,661.96	-1,442,052.78

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

## 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	30,309,985.79	37,125,583.24
第二层次	122,078.38	-
第三层次	-	-
合计	30,432,064.17	37,125,583.24

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

## 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2021 年 12 月 31 日：同)。

## 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	30,432,064.17	84.79

	其中：股票	30,432,064.17	84.79
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	4,880,222.07	13.60
8	其他各项资产	579,200.03	1.61
9	合计	35,891,486.27	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 30,432,064.17 元，占基金资产净值的比例为 85.25%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票投资。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	582,204.80	1.63
周期性消费品	3,093,225.21	8.67
非周期性消费品	4,582,958.10	12.84
综合	573,020.06	1.61
能源	1,551,391.61	4.35
金融	11,365,423.08	31.84
基金	-	-
工业	1,092,884.10	3.06
信息技术	888,555.24	2.49
公用事业	717,953.39	2.01
通讯	5,984,448.58	16.76
合计	30,432,064.17	85.25

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	10,300	3,121,717.16	8.75
2	00939	建设银行	309,000	1,392,617.05	3.90
3	03690	美团-W	8,100	1,345,230.97	3.77

4	01299	友邦保险	17,800	1,294,663.59	3.63
5	00005	汇丰控股	27,600	1,219,107.55	3.42
6	03988	中国银行	390,378	1,044,942.24	2.93
7	01288	农业银行	290,000	734,095.10	2.06
8	01211	比亚迪股份	2,500	671,324.15	1.88
9	03328	交通银行	143,000	662,823.56	1.86
10	00363	上海实业控股	62,000	601,266.99	1.68
11	09633	农夫山泉	15,400	593,305.17	1.66
12	01339	中国人民保险集团	285,000	584,949.96	1.64
13	00941	中国移动	12,772	535,201.85	1.50
14	00883	中国海洋石油	60,000	531,586.10	1.49
15	00867	康哲药业	47,000	491,973.70	1.38
16	01088	中国神华	25,500	490,665.26	1.37
17	02328	中国财险	70,000	488,484.53	1.37
18	00728	中国电信	204,000	465,804.89	1.30
19	01816	中广核电力	280,000	454,961.08	1.27
20	00388	香港交易所	1,300	429,134.34	1.20
21	01378	中国宏桥	51,500	390,655.07	1.09
22	02269	药明生物	5,500	337,714.53	0.95
23	03301	融信中国	202,500	337,693.15	0.95
24	00267	中信股份	49,000	333,139.26	0.93
25	00998	中信银行	107,000	321,183.71	0.90
26	01513	丽珠医药	13,300	308,804.83	0.87
27	03320	华润医药	67,000	305,396.90	0.86
28	01308	海丰国际	16,000	303,763.49	0.85
29	00921	海信家电	40,000	303,079.34	0.85
30	01929	周大福	23,600	297,893.46	0.83
31	01890	中国科培	162,000	285,394.01	0.80
32	00168	青岛啤酒股份	4,000	279,134.02	0.78
33	00874	白云山	14,000	275,371.18	0.77
34	02001	新高教集团	116,000	266,853.49	0.75
35	01972	太古地产	15,200	253,218.34	0.71
36	02678	天虹纺织	35,500	251,981.73	0.71
37	01024	快手-W	3,300	246,653.90	0.69
38	00019	太古股份公司 A	6,000	239,880.80	0.67
39	01919	中远海控	25,500	239,008.50	0.67
40	00992	联想集团	38,000	238,204.62	0.67
41	00960	龙湖集团	7,500	237,635.92	0.67
42	00522	ASMPT	3,900	222,293.81	0.62
43	01658	邮储银行	40,000	213,113.35	0.60
44	02318	中国平安	4,500	205,309.74	0.58
45	00006	电能实业	4,500	189,916.32	0.53

46	06618	京东健康	3,550	186,861.15	0.52
47	01099	国药控股	11,200	182,175.99	0.51
48	02669	中海物业	25,000	180,658.89	0.51
49	06066	中信建投证券	24,500	174,321.93	0.49
50	00639	首钢资源	62,000	172,851.00	0.48
51	02899	紫金矿业	20,000	164,367.52	0.46
52	03888	金山软件	6,200	162,246.65	0.45
53	03669	永达汽车	24,500	155,464.99	0.44
54	01052	越秀交通基建	40,000	154,960.43	0.43
55	00341	大家乐集团	14,000	151,094.97	0.42
56	01618	中国中冶	91,000	146,305.91	0.41
57	00780	同程旅行	10,000	144,356.07	0.40
58	00135	昆仑能源	26,000	142,970.66	0.40
59	00751	创维集团	42,000	139,361.76	0.39
60	00144	招商局港口	12,000	136,898.82	0.38
61	06881	中国银河	34,500	133,653.37	0.37
62	01585	雅迪控股	10,000	131,357.18	0.37
63	01109	华润置地	4,000	125,199.82	0.35
64	00570	中国中药	30,000	124,430.15	0.35
65	06110	滔搏	20,000	121,950.09	0.34
66	02343	太平洋航运	47,000	120,581.79	0.34
67	01113	长实集团	2,500	118,657.61	0.33
68	00688	中国海外发展	5,500	116,647.92	0.33
69	09666	金科服务	6,400	110,558.96	0.31
70	06690	海尔智家	4,200	104,341.73	0.29
71	02238	广汽集团	16,000	103,854.27	0.29
72	06869	长飞光纤光缆	9,000	103,597.72	0.29
73	00220	统一企业中国	17,000	97,842.29	0.27
74	00995	安徽皖通高速公路	18,000	97,594.28	0.27
75	01347	华虹半导体	4,000	97,149.58	0.27
76	00856	伟仕佳杰	18,000	96,670.68	0.27
77	01093	石药集团	14,000	93,267.02	0.26
78	02331	李宁	1,500	93,258.47	0.26
79	00667	中国东方教育	25,500	90,718.56	0.25
80	00590	六福集团	5,000	86,160.39	0.24
81	00506	中国食品	36,000	85,587.42	0.24
82	01171	兖矿能源	4,000	84,150.70	0.24
83	02333	长城汽车	6,000	82,816.60	0.23
84	06160	百济神州	900	75,812.59	0.21
85	00354	中国软件国际	10,000	68,671.76	0.19
86	01898	中煤能源	12,000	68,244.16	0.19
86	09909	宝龙商业	15,000	68,244.16	0.19

87	01951	锦欣生殖	10,500	64,921.75	0.18
88	02357	中航科工	15,000	57,597.05	0.16
89	03998	波司登	12,000	49,977.30	0.14
90	03868	信义能源	14,000	48,130.09	0.13
91	00881	中升控股	1,000	47,334.77	0.13
92	00813	世茂集团	12,500	47,249.25	0.13
93	01755	新城悦服务	6,000	46,847.31	0.13
94	03380	龙光集团	25,000	46,607.86	0.13
95	03968	招商银行	1,000	44,897.48	0.13
96	06078	海吉亚医疗	1,000	44,598.16	0.12
97	03311	中国建筑国际	6,000	44,538.30	0.12
98	09983	建业新生活	12,000	39,920.27	0.11
99	09869	海伦司	2,500	38,697.35	0.11
100	02618	京东物流	2,400	35,138.05	0.10
101	00669	创科实业	500	34,998.65	0.10
102	02359	药明康德	380	33,959.59	0.10
103	01238	宝龙地产	30,000	33,608.97	0.09
104	00902	华能国际电力股份	10,000	33,437.93	0.09
105	02009	金隅集团	33,000	32,172.25	0.09
106	03933	联邦制药	8,000	31,813.07	0.09
107	06098	碧桂园服务	1,000	29,888.89	0.08
108	00390	中国中铁	7,000	29,033.70	0.08
109	06993	蓝月亮集团	5,000	28,648.87	0.08
110	03333	中国恒大	20,000	28,221.27	0.08
111	00836	华润电力	2,000	27,708.16	0.08
112	00839	中教控股	4,000	26,545.10	0.07
113	02196	复星医药	1,000	24,843.27	0.07
114	02313	申洲国际	300	24,385.74	0.07
115	03339	中国龙工	15,000	24,372.92	0.07
116	00763	中兴通讯	1,400	21,886.02	0.06
117	00358	江西铜业股份	2,000	18,369.48	0.05
118	01610	中粮家佳康	5,000	16,248.61	0.05
119	06862	海底捞	1,000	15,649.98	0.04
120	00175	吉利汽车	1,000	15,256.59	0.04
121	02096	先声药业	2,000	14,709.27	0.04
122	00819	天能动力	2,000	14,521.13	0.04
123	00636	嘉里物流	1,000	14,435.61	0.04
124	03759	康龙化成	200	13,435.03	0.04
125	00857	中国石油股份	4,000	12,793.64	0.04
126	00392	北京控股	500	11,929.90	0.03
127	02382	舜宇光学科技	100	10,937.88	0.03
128	01787	山东黄金	750	8,812.73	0.02

129	01691	JS 环球生活	500	4,370.02	0.01
130	09959	联易融科技-W	500	3,318.14	0.01
131	01958	北京汽车	1,000	2,232.05	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	2,244,102.38	5.11
2	00939	建设银行	1,774,260.23	4.04
3	01513	丽珠医药	1,203,102.90	2.74
4	00590	六福集团	1,127,084.24	2.57
5	03690	美团-W	1,109,102.02	2.52
6	00522	ASMPT	1,034,952.99	2.36
7	00144	招商局港口	971,464.37	2.21
8	01378	中国宏桥	916,953.17	2.09
9	00867	康哲药业	894,157.70	2.04
10	00267	中信股份	864,354.95	1.97
11	01299	友邦保险	853,662.81	1.94
12	03328	交通银行	835,868.89	1.90
13	00992	联想集团	835,767.74	1.90
14	00883	中国海洋石油	800,732.58	1.82
15	09633	农夫山泉	720,778.57	1.64
16	00728	中国电信	712,035.42	1.62
17	01816	中广核电力	708,511.27	1.61
18	01088	中国神华	692,277.03	1.58
19	02328	中国财险	684,614.95	1.56
20	01113	长实集团	662,502.12	1.51

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。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	2,361,046.03	5.37
2	03690	美团-W	1,846,010.81	4.20
3	00939	建设银行	1,172,891.73	2.67
4	01113	长实集团	1,161,110.76	2.64
5	01088	中国神华	1,085,708.75	2.47
6	09633	农夫山泉	1,049,957.80	2.39
7	01378	中国宏桥	1,049,747.54	2.39



8	01513	丽珠医药	1,045,892.88	2.38
9	00590	六福集团	1,029,051.21	2.34
10	00857	中国石油股份	1,007,965.21	2.29
11	00874	白云山	1,003,768.35	2.29
12	00005	汇丰控股	969,993.46	2.21
13	00604	深圳控股	943,073.70	2.15
14	06881	中国银河	890,626.83	2.03
15	00856	伟仕佳杰	868,751.26	1.98
16	03988	中国银行	864,209.95	1.97
17	01929	周大福	849,196.31	1.93
18	01888	建滔积层板	842,137.24	1.92
19	00981	中芯国际	841,548.39	1.92
20	00144	招商局港口	832,423.79	1.90

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。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	60,233,072.18
卖出股票收入（成交）总额	66,735,661.17

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。

### 7.5 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投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 7.11.2 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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

2021 年 7 月 6 日，腾讯控股有限公司（以下简称“腾讯控股”，股票代码：00700.HK）因违法实施的经营集中，但不具有排除、限制竞争的效果，收到市场监管总局的行政处罚决定书（国市监处〔2021〕59 号、国市监处〔2021〕61 号、国市监处〔2021〕65 号），分别被处以罚款人民币 50 万元，共计 150 万元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对腾讯控股进行了投资。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”，股票代码：601939、0939.HK）于 2021 年 8 月 20 日收到中国人民银行出具的行政处罚决定书（银罚字〔2021〕22 号），其因占压财政存款或者资金、违反账户管理规定，被处以罚款人民币 388 万元。

建设银行于 2022 年 3 月 21 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〔2022〕14 号），其因贸易融资业务 EAST 数据存在偏差、贷款核销业务 EAST 数据存在偏差等多项违法违规行为，被处以罚款人民币 470 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建设银行进行了投资。

美团于 2021 年 10 月 8 日收到市场监管总局出具的行政处罚决定（国市监处罚〔2021〕74 号），其因违反《反垄断法》相关规定，构成滥用市场支配地位行为，被处罚款共计人民币 3,442,439,866 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美团进行了投资。

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 2022 年 3 月 21 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〔2022〕13 号）。

其因不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差等多项违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，被处以 480 万元罚款。

2022 年 5 月 26 日，中国银行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(2022)29 号)。其因老产品规模在部分时点出现反弹违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，被处以 200 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。

中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”，股票代码：601288、1288.HK）于 2021 年 12 月 8 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)38 号)。其因制定文件要求企业对公账户必须开通属于该行收费项目的动账短信通知服务，侵害客户自主选择权等问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，被处以罚款 150 万元。

农业银行于 2022 年 3 月 21 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(2022)12 号)。其因漏报贷款核销业务 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据等多项违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，被处以罚款 480 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农业银行进行了投资。

交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”，股票代码：601328、3328.HK）于 2021 年 7 月 13 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)28 号)。其因理财业务和同业业务制度不健全、理财业务数据与事实不符、部分理财业务发展与监管导向不符等，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，被处以 4100 万元罚款。

2021 年 8 月 13 日，交通银行收到中国人民银行出具的行政处罚决定书（银罚字(2021)23 号），其因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，被处以罚款人民币 62 万元。

2021 年 10 月 20 日，交通银行因未按规定办理内存外贷业务等违法违规事项，被国家外汇管理局上海市分局（上海汇管罚字(2021)3111210701 号）责令改正，给予警告，处罚款 340 万元人民币，没收违法所得 823,166.01 元人民币的行政处罚。

2022 年 3 月 21 日，交通银行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（2022）15 号），其因漏报不良贷款余额 EAST 数据、贸易融资业务 EAST 数据存在偏差等违法违规行为，被处以罚款人民币 420 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交通银行进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	123,370.51
2	应收清算款	-
3	应收股利	453,595.43
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,234.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	579,200.03

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (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 (%)
1,352	29,944.37	20,018,000.00	49.45	20,466,793.78	50.55

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	102,656.75	0.253569

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2019 年 6 月 19 日) 基金份额总额	222,337,194.36
本报告期期初基金份额总额	49,139,745.87
本报告期基金总申购份额	38,306,540.48
减：本报告期基金总赎回份额	46,961,492.57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	40,484,793.78

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、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。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国盛证券有限责任公司	1	21,785,767.95	17.16	17,429.34	17.16	-
中信证券股份有限公司	3	19,721,503.97	15.53	15,776.90	15.53	-
中信建投证券股份有限公司	2	16,998,918.83	13.39	13,599.29	13.39	-
中航证券股份有限公司	1	14,009,782.90	11.03	11,208.36	11.03	本期新增
海通证券股份有限公司	1	13,861,567.58	10.92	11,088.98	10.92	-
天风证券股份有限公司	1	10,071,369.50	7.93	8,057.00	7.93	-
长城证券股份有限公司	2	8,875,545.24	6.99	7,100.67	6.99	-
安信证券股份有限公司	2	8,831,266.88	6.96	7,064.85	6.96	-
国海证券股份有限公司	1	7,167,072.71	5.64	5,733.63	5.64	-
华创证券有限责任公司	1	5,645,937.79	4.45	4,516.52	4.45	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞信证券（中国）有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	3	-	-	-	-	本期新增 1 个
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞信证券（中国）有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2022 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-01
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-01
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行个人电子银行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	2022-01-01
4	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执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-01
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金 2022 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	2022-01-04
6	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	2022-01-07



	停机维护的公告	网站	
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富证券为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-07
8	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	2022-01-20
9	景顺长城量化港股通股票型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-24
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-24
11	关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-25
12	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	2022-01-26
13	景顺长城基金管理有限公司关于投资旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-27
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万得基金为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-28
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-18
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	2022-02-25
17	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-04
18	关于旗下部分基金参加西部证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-10
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-28
20	景顺长城量化港股通股票型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-28
21	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	2022-03-29
22	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机升级的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-08
23	景顺长城基金管理有限公司关于持续	中国证监会指定报刊及	2022-04-12

	完善客户身份信息的提示	网站	
24	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	2022-04-13
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	2022-04-16
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和讯科技为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-21
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	2022-04-22
28	景顺长城基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯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	2022-04-22
29	景顺长城量化港股通股票型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
31	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	2022-04-26
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	2022-04-29
33	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	2022-05-05
34	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-06
35	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	2022-05-12
36	关于旗下部分基金新增浦领基金为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-16
37	关于旗下部分基金新增攀赢基金为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-26
38	景顺长城基金管理有限公司关于暂停腾元基金、汇付基金、南京途牛和有鱼基金办理旗下基金相关销售业务的	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-26

	公告		
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	2022-06-10
40	景顺长城量化港股通股票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	2022-06-16
41	关于旗下部分基金参加申万宏源证券和申万宏源西部证券基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-22
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	2022-06-24
43	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	2022-06-29

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220101-20220630	20,018,000.00	0.00	0.00	20,018,000.00	49.45
	2	20220101-20220210	12,569,135.56	0.00	12,569,135.56	0.00	0.00

#### 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) 基金在短期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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城量化港股通股票型证券投资基金募集注册的文件;
- 2、《景顺长城量化港股通股票型证券投资基金基金合同》;
- 3、《景顺长城量化港股通股票型证券投资基金招募说明书》;
- 4、《景顺长城量化港股通股票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。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 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 8 月 31 日