

景顺长城大中华混合型证券投资基金 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

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	8
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	39

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	41
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	41
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	41
7.11 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城大中华混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城大中华混合（QDII）
基金主代码	262001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 22 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	594,339,158.13 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	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 境外投资顾问和境外资产托管人

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

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金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

2.6 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	-170,417,281.81
本期利润	-80,842,254.74
加权平均基金份额本期利润	-0.1360
本期加权平均净值利润率	-7.45%
本期基金份额净值增长率	-6.26%
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	49,537,911.91
期末可供分配基金份额利润	0.0833
期末基金资产净值	1,120,694,783.09
期末基金份额净值	1.886
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	143.22%

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三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计

入基金资产。

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

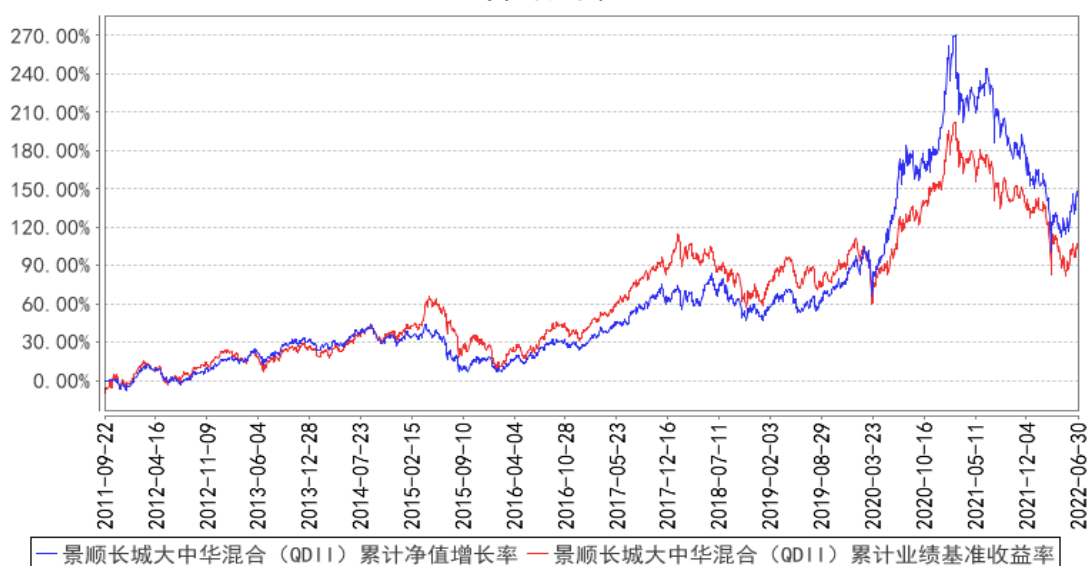
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.72%	1.84%	-0.25%	1.59%	4.97%	0.25%
过去三个月	6.80%	1.80%	-4.22%	1.76%	11.02%	0.04%
过去六个月	-6.26%	1.85%	-14.35%	1.92%	8.09%	-0.07%
过去一年	-28.96%	1.68%	-27.18%	1.60%	-1.78%	0.08%
过去三年	51.73%	1.64%	8.81%	1.44%	42.92%	0.20%
自基金合同生效起至今	143.22%	1.18%	101.61%	1.20%	41.61%	-0.02%

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

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



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

3.3 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		
周寒颖	本基金的基金经理	2016 年 6 月 3 日	-	16 年	工商管理硕士。曾任招商基金研究部研究员、高级研究员、国际业务部高级研究员。2015 年 7 月加入本公司，担任研究部高级研究员，自 2016 年 6 月起担任国际投资部基金经理。具有 16 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 投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
----	-----------	--------	----

萧 光 一 (MikeShiao)	首席投资总监	30	美国宾夕法尼亚州卓克索大学（Drexel University）金融理学硕士。2002 年加盟景顺，并于 2015 年出任大中华首席投资总监，带领大中华区股票团队，并于 2016 年 4 月担任亚洲区（日本除外）的首席投资总监。萧先生自 2008 年起已为景顺大中华基金的首席基金经理，并于 2014 年 7 月起担任亚洲机遇股票投资组合的首席基金经理。他同时负责中国智选股票等投资组合，以及投资于中国香港/大陆的机构客户投资组合。在此之前，萧先生为中国台湾景顺投信的股票部主管，其后于 2006 年加入位于中国香港的景顺投资管理有限公司，以拓展其覆盖至大中华市场。萧先生在 1992 年开始投身投资业界，在 Grand Regent Investment Ltd. 担任项目经理达六年之久，管理中国台湾及大陆的创业基金的活动。他于 1997 年加盟 Overseas Credit and Securities Inc.，担任高级分析员，负责研究中国台湾的科技板块。萧先生亦曾于 Taiwan International Investment Management Co. 担任基金经理，负责科技业的研究工作。
----------------------	--------	----	--

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

6 月，中国制造业 PMI 为 50.2%，较上个月回升 0.6 个百分点；中国非制造业 PMI 为 54.7%，较上个月显著回升 6.9 个百分点。随着国内疫情防控形势持续向好，稳经济一揽子政策措施加快落地生效，制造业景气在连续三个月收缩后重返扩张区间，6 月份生产指数略强于过去五年季节性平均水平。上游资源品价格出现回调，带动工业品价格环比下行，一定程度上缓解中下游企业的成本压力，助力中小企业复苏。后续在强调高效统筹疫情防控和经济社会发展的背景下，宏观经济短期将延续探底回升势头。

统计局 6 月地产数据，销售额单月-21%，较上月收窄 17pc，符合预期。但投资、开工、竣工数据依然偏差，单月投资-9%、开工-45%、竣工-41%。拿地主体方面，部分央企国企货值补充相对更多一些。

6 月 28 日，国家卫健委发布了《新型冠状病毒肺炎防控方案（第九版）》，明显缩短了防疫的隔离时间，也避免部分地区出现过度防控的情况；6 月 29 日，工信部为了方便民众出行，取消通信行程卡“星号”标记。疫情防控政策出现微调，更加强调高效统筹疫情防控和经济社会发展。在这样的背景下，后续即便发生散点疫情，对整体经济运行的扰动将明显低于二季度，尤其是服务业的景气度将有明显提振。

2022 年截至 6 月 30 日，上证指数跌幅为 6.63%，深证成指、创业板指的跌幅为 13.20%、15.41%，恒生指数及恒生科技指数则分别下跌 6.57%和 14.12%；道琼斯工业指数、标普 500 指数、纳斯达克综合指数的跌幅分别为 15.31%、20.58%、29.51%。

上半年整体而言，A 股和港股市场表现优于美股。特别是 5 月至今，在美联储超预期收紧和经济衰退预期发酵的背景下，海外股市普遍出现较大幅度调整，盈利预期下调将继续压制美股，在美联储货币政策转向的预期形成前，美股预计难迎来持续反弹，“衰退交易”仍将是贯穿美股市场三季度的主题。美股三大指数顶部回落 20%，主要是估值回归，但美股盈利从 7 月开始下修，预计持续到下半年（历史平均 8 个月，幅度-17%），10 月之后油价基数效应有助于通胀回落，需要再评估美国金融紧缩对自身通胀和经济增长制约的影响，以及其他国家金融困境对全球经济的影响，经济增长前景的不确定性是全球共同面对的问题；基于国内疫情形势好转、宏观经济触底反弹及货币政策保持相对独立性，A 股成为全球资金的避风港，结构性行情突出，光伏、储能和新能源汽车板块相关个股走势强劲。港股经历过 4-5 月反弹，6 月 14 日跟随美股下行回吐部分涨幅，从节奏上看，7 月消化估值，8 月中报后盈利预见更加明确，不排除上修，9 月后进入盈利和估值较为顺畅的投资甜点区。

A 股市场经过 5、6 月的反弹，结构性行情演绎得淋漓尽致，创业板指数的估值水平得到大幅

修复，动态 P/E 分位已从历史低点回升到中位数附近；沪深 300 的估值水平也回到 40%分位水平（2010 年以来）。市场整体的修复已经基本完成，后续市场的上升空间取决于基本面的回升力度和持续性。当前疫情防控出现一定程度放松后，疫情又出现反弹，后续疫情防控政策的调整方向需要密切留意，其对宏观经济的影响、上市公司盈利状况的改善和市场信心的影响较为重要。

在通胀超预期创新高背景下，美联储 6 月议息会议自 1994 年 11 月以来首次加息 75bps。美联储强调对抗通胀的坚定决心，目前阶段遏制通货膨胀成为美联储货币政策的第一选项，但连续大幅度加息将加大美国经济陷入衰退的风险。各主流卖方机构纷纷调降美国今明两年的经济增速预期，后续市场主导逻辑或将转向经济衰退。世界银行认为，当前经济前景面临的一个主要风险是全球通胀高企的同时增长乏力。这种情况迫使发达经济体大幅收紧货币政策，进而导致一些新兴市场和新兴经济体的金融困境。

4.5.2 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-6.26%，业绩比较基准收益率为-14.35%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

看好方向：整体上 TMT 和互联网都在估值底部区域，相对预期不高，具有良好的投资性价比。比如通信和新能源方向、计算机和工业软件方向、功率半导体、军工航发产业链和集成电路方向、新能源和储能方向、新型船舶制造和低碳方向等等。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，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。

相关定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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：景顺长城大中华混合型证券投资基金

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
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	151,088,180.20	304,264,191.16

结算备付金		14,795,112.67	-
存出保证金		217,777.64	-
交易性金融资产	6.4.7.2	974,411,640.23	909,721,512.08
其中：股票投资		974,411,640.23	909,721,512.08
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		9,396,576.63	356,378.91
应收申购款		2,274,736.10	1,954,043.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	24,731,419.67	17,190.98
资产总计		1,176,915,443.14	1,216,313,316.64
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
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		24,716,597.67	78.36
应付赎回款		4,476,580.00	12,575,141.27
应付管理人报酬		1,612,780.91	1,872,629.79
应付托管费		313,596.29	364,122.47
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	25,101,105.18	448,066.58
负债合计		56,220,660.05	15,260,038.47
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	594,339,158.13	596,968,770.58
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	526,355,624.96	604,084,507.59

净资产合计		1,120,694,783.09	1,201,053,278.17
负债和净资产总计		1,176,915,443.14	1,216,313,316.64

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 594,339,158.13 份，其中人民币基金份额净值人民币 1.886 元，基金份额总额 590,837,981.53 份；美元基金份额净值美元 0.281 元，基金份额总额 3,501,176.60 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城大中华混合型证券投资基金

本报告期：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 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
一、营业总收入		-69,086,289.65	52,304,309.16
1. 利息收入		179,465.26	312,195.76
其中：存款利息收入	6.4.7.9	179,465.26	312,195.76
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）		-164,888,756.89	60,160,289.77
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-184,132,164.48	50,884,322.45
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	19,243,407.59	9,275,967.32
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）	6.4.7.15	89,575,027.07	-8,075,990.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		5,856,110.83	-1,396,505.32
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	191,864.08	1,304,319.41
减：二、营业总支出		11,755,965.09	29,005,881.28

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,729,178.18	15,757,179.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,891,784.61	3,063,895.97
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.17	135,002.30	10,184,806.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-80,842,254.74	23,298,427.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-80,842,254.74	23,298,427.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-80,842,254.74	23,298,427.88

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城大中华混合型证券投资基金

本报告期：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）	596,968,770.58	-	604,084,507.59	1,201,053,278.17
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）	596,968,770.58	-	604,084,507.59	1,201,053,278.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,629,612.45	-	-77,728,882.63	-80,358,495.08
（一）、综合收益总额	-	-	-80,842,254.74	-80,842,254.74
（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）	-2,629,612.45	-	3,113,372.11	483,759.66
其中：1. 基金申购款	110,294,160.45	-	91,059,837.14	201,353,997.59

2. 基金赎回款	-112,923,772.90	-	-87,946,465.03	-200,870,237.93
（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）	594,339,158.13	-	526,355,624.96	1,120,694,783.09
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）	239,616,056.07	-	329,100,744.55	568,716,800.62
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）	239,616,056.07	-	329,100,744.55	568,716,800.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	464,890,087.83	-	837,055,504.09	1,301,945,591.92
（一）、综合收益总额	-	-	23,298,427.88	23,298,427.88
（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）	464,890,087.83	-	813,757,076.21	1,278,647,164.04
其中：1. 基金申购款	825,414,126.91	-	1,372,152,866.62	2,197,566,993.53
2. 基金赎回款	-360,524,039.08	-	-558,395,790.41	-918,919,829.49
（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）	704,506,143.90	-	1,166,156,248.64	1,870,662,392.54

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：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城大中华混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 709 号《关于核准景顺长城大中华股票型证券投资基金募集的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城大中华股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 291,060,560.03 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 367 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城大中华股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 291,092,562.55 份基金份额,其中认购资金利息折合 32,002.52 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司,境外资产托管人为渣打银行(香港)有限公司(Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited)。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为股票及其他权益类证券、现金、债券、股指期货及中国证监会允许投资的其它金融工具。本基金对于股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的 60%,其中投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及在其他证券市场交易的大中华企业的资产不低于基金股票及其他权益类资产的 80%;持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款。本基金的业绩比较基准为:摩根斯坦利金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)。

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

费用及其他相关费用。投资者在申购基金份额时可自行选择基金份额类别，并交付相应币种的款项。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2022 年 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基金投资，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。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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、应收利息、应收股利和应收申购款，金额分别为 304,264,191.16 元、0.00 元、17,190.98 元、356,378.91 元和 1,954,043.51 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、其他资产-应收利息、应收股利和应收申购款，金额分别为 304,280,541.75 元、840.39 元、0.00 元、356,378.91 元和 1,954,043.51 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 909,721,512.08 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 909,721,512.08 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 78.36 元、12,575,141.27 元、1,872,629.79 元、364,122.47 元、201,755.32 元和 46,311.26 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 78.36 元、12,575,141.27 元、1,872,629.79 元、364,122.47 元、201,755.32 元和 46,311.26 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利

收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的其他源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

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

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

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	151,088,180.20
等于：本金	151,081,990.01
加：应计利息	6,190.19
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	151,088,180.20

注：于 2022 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 54,309,664.94 元（折合人民币 46,445,082.36 元），美元 891,587.05 元（折合人民币 5,983,797.33 元），新台币 181,361,495.00 元（折合人民币 40,924,939.06 元）

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	1,009,326,159.57	-	974,411,640.23	-34,914,519.34
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,009,326,159.57	-	974,411,640.23	-34,914,519.34

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	24,716,530.70
待摊费用	14,888.97
合计	24,731,419.67

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	12,431.31
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	257,273.24
其中：交易所市场	257,273.24
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94

其他	24,722,304.69
合计	25,101,105.18

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	596,968,770.58	596,968,770.58
本期申购	110,294,160.45	110,294,160.45
本期赎回（以“-”号填列）	-112,923,772.90	-112,923,772.90
本期末	594,339,158.13	594,339,158.13

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	220,084,941.07	383,999,566.52	604,084,507.59
本期利润	-170,417,281.81	89,575,027.07	-80,842,254.74
本期基金份额交易产生的变动数	-129,747.35	3,243,119.46	3,113,372.11
其中：基金申购款	24,915,940.10	66,143,897.04	91,059,837.14
基金赎回款	-25,045,687.45	-62,900,777.58	-87,946,465.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,537,911.91	476,817,713.05	526,355,624.96

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	161,018.05
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	18,380.05
其他	67.16
合计	179,465.26

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	1,216,537,692.20
减：卖出股票成本总额	1,394,516,568.66
减：交易费用	6,153,288.02
买卖股票差价收入	-184,132,164.48

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 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	19,243,407.59
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	19,243,407.59

6.4.7.15 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	89,575,027.07
股票投资	89,575,027.07
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	89,575,027.07

6.4.7.16 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	191,864.08
合计	191,864.08

6.4.7.17 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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	384.00
税务代理费	14,139.48
证券组合费	11,382.88
合计	135,002.30

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
渣打银行（香港）有限公司（“渣打银行（香港）”）	境外资产托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺长城资产管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 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	
	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	35,374,405.90	1.37	23,216,084.94	0.45

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	28,300.06	1.11	28,300.06	11.00
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	18,572.71	0.39	-	-

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	9,729,178.18	15,757,179.15
其中：支付销售机构的客户维护费	2,524,977.54	3,782,188.20

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.80% / 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	1,891,784.61	3,063,895.97

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.35% / 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
景顺长城资产管理（深圳）有限公司	2,534,211.86	0.4300	—	—

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
渣打银行-活期	87,932,992.62	5,859.14	87,489,758.38	11,257.21
中国工商银行-活期	63,155,187.58	155,158.91	93,655,813.82	260,858.55

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

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

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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同责任，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组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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	109,593,932.14	-	-	-	-	41,494,248.06	151,088,180.20
结算备付金	14,795,112.67	-	-	-	-	-	14,795,112.67
存出保证金	217,777.64	-	-	-	-	-	217,777.64
交易性金融资产	-	-	-	-	-	974,411,640.23	974,411,640.23
应收股利	-	-	-	-	-	9,396,576.63	9,396,576.63
应收申购款	25,827.85	-	-	-	-	2,248,908.25	2,274,736.10
其他资产	-	-	-	-	-	24,731,419.67	24,731,419.67
资产总计	124,632,650.30	-	-	-	-	1,052,282,792.84	1,176,915,443.14
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	4,476,580.00	4,476,580.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,612,780.91	1,612,780.91
应付托管费	-	-	-	-	-	313,596.29	313,596.29
应付证券清算款	-	-	-	-	-	24,716,597.67	24,716,597.67
其他负债	-	-	-	-	-	25,101,105.18	25,101,105.18
负债总计	-	-	-	-	-	56,220,660.05	56,220,660.05
利率敏感度缺口	124,632,650.30	-	-	-	-	-	-
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	278,557,327.08	-	-	-	-	25,706,864.08	304,264,191.16
交易性金融资产	-	-	-	-	-	909,721,512.08	909,721,512.08
应收利息	-	-	-	-	-	17,190.98	17,190.98
应收股利	-	-	-	-	-	356,378.91	356,378.91
应收申购款	15,850.39	-	-	-	-	1,938,193.12	1,954,043.51
资产总计	278,573,177.47	-	-	-	-	937,740,139.17	1,216,313,316.64
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,575,141.27	12,575,141.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,872,629.79	1,872,629.79
应付托管费	-	-	-	-	-	364,122.47	364,122.47
应付证券清算款	-	-	-	-	-	78.36	78.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	201,755.32	201,755.32
其他负债	-	-	-	-	-	246,311.26	246,311.26
负债总计	-	-	-	-	-	15,260,038.47	15,260,038.47
利率敏感度缺口	278,573,177.47	-	-	-	-	-	-

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				

银行存款	5,983,797.33	46,445,082.36	40,924,939.06	93,353,818.75
交易性金融资产	141,045,146.76	762,582,457.51	70,784,035.96	974,411,640.23
应收股利	-	6,909,664.98	275,020.84	7,184,685.82
其他资产	24,731,419.67	-	-	24,731,419.67
资产合计	171,760,363.76	815,937,204.85	111,983,995.86	1,099,681,564.47
以外币计价的负债				
应付证券清算款	24,716,530.70	-	-	24,716,530.70
应付赎回款	15,552.93	-	-	15,552.93
其他负债	58.66	24,722,304.69	-	24,722,363.35
负债合计	24,732,142.29	24,722,304.69	-	49,454,446.98
资产负债表外汇 风险敞口净额	147,028,221.47	791,214,900.16	111,983,995.86	1,050,227,117.49
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				
银行存款	4,221,763.48	113,704,197.57	25,695,632.26	143,621,593.31
交易性金融资产	23,295,157.38	815,716,705.81	70,709,648.89	909,721,512.08
应收利息	12.62	-	-	12.62
应收股利	-	-	249,783.27	249,783.27
资产合计	27,516,933.48	929,420,903.38	96,655,064.42	1,053,592,901.28
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	27,516,933.48	929,420,903.38	96,655,064.42	1,053,592,901.28

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		
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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	52,511,355.87	52,679,645.06
	所有外币相对人民币贬值 5%	-52,511,355.87	-52,679,645.06

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	974,411,640.23	86.95	909,721,512.08	75.74
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	974,411,640.23	86.95	909,721,512.08	75.74

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）
	沪深 300 指数上升 5%	58,168,496.03	58,667,105.07
分析	沪深 300 指数下降 5%	-58,168,496.03	-58,667,105.07

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	974,411,640.23	909,721,512.08
第二层次	—	—
第三层次	—	—
合计	974,411,640.23	909,721,512.08

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；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

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	974,411,640.23	82.79
	其中：普通股	833,366,493.47	70.81
	存托凭证	141,045,146.76	11.98

	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	165,883,292.87	14.09
8	其他各项资产	36,620,510.04	3.11
9	合计	1,176,915,443.14	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 294,178,259.36 元，占基金资产净值比例为 26.25%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	762,582,457.51	68.05
美国	141,045,146.76	12.59
中国台湾	70,784,035.96	6.32
合计	974,411,640.23	86.95

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
原材料	9,418,258.78	0.84
周期性消费品	100,622,967.25	8.98
非周期性消费品	157,773,704.35	14.08
综合	—	—
能源	50,722,174.09	4.53
金融	96,564,465.78	8.62
基金	—	—
工业	139,265,553.53	12.43
信息科技	70,784,035.96	6.32
公用事业	—	—
通讯	349,260,480.49	31.16
合计	974,411,640.23	86.95

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	阿里巴巴	9988 HK	香港联合交易所	中国香港	629,500	60,240,481.55	5.38
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	纽约证券交易所	美国	31,078	23,711,020.76	2.12
2	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	微创医疗	853 HK	香港联合交易所	中国香港	4,021,100	78,232,802.58	6.98
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台积电	2330 TT	台湾证券交易所	中国台湾	659,000	70,784,035.96	6.32
4	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	中车时代电气	3898 HK	香港联合交易所	中国香港	1,891,000	62,584,258.03	5.58
6	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港交易所	388 HK	香港联合交易所	中国香港	176,500	58,263,239.51	5.20
7	MEITUAN DIANPING	美团点评	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	331,200	55,004,999.82	4.91
8	CNOOC LTD	中国海洋石油	883 HK	香港联合交易所	中国香港	5,725,000	50,722,174.09	4.53
9	PINDUODUO INC-ADR	拼多多	PDD US	纳斯达克证券交易所	美国	116,854	48,466,893.22	4.32
10	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	海丰国际	1308 HK	香港联合交易所	中国香港	2,223,000	42,204,139.61	3.77
11	JD.com Inc.	京东	9618 HK	香港联合交易所	中国香港	194,050	41,952,063.81	3.74
12	KUAISHOU-W	快手	1024 HK	香港联合交易所	中国香港	474,000	35,428,469.25	3.16
13	Morimatsu International Holdin	森松国际	2155 HK	香港联合交易所	中国香港	5,448,000	34,477,155.89	3.08
14	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	113,000	34,247,964.97	3.06
15	LI NING CO LTD	李宁	2331 HK	香港联合交易所	中国香港	486,500	30,246,830.27	2.70
16	BYD CO LTD-H	比亚迪股份	1211 HK	香港联合交易所	中国香港	99,500	26,718,701.17	2.38
17	Genscript Biotech Corp	金斯瑞生物科技	1548 HK	香港联合交易所	中国香港	1,086,000	26,422,548.87	2.36

18	Tsingtao Brewery Co Ltd	青岛啤酒股份	168 HK	香港联合交易所	中国香港	366,000	25,540,762.46	2.28
19	Trip.com Group Ltd	携程网	TCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	132,140	24,343,878.67	2.17
20	KE HOLDINGS INC	贝壳集团	BEKE US	纽约证券交易所	美国	201,535	24,278,846.88	2.17
21	Yadea Group Holdings Ltd	雅迪控股	1585 HK	香港联合交易所	中国香港	1,806,000	23,723,107.43	2.12
22	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	新东方教育科技集团	EDU US	纽约证券交易所	美国	148,155	20,244,507.23	1.81
23	CHINA MOBILE LTD	中国移动	941 HK	香港联合交易所	中国香港	478,000	20,030,260.18	1.79
24	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华控股	1999 HK	香港联合交易所	中国香港	2,748,800	19,934,328.38	1.78
25	CHINA RESOURCES LAND LTD	华润置地	1109 HK	香港联合交易所	中国香港	448,000	14,022,379.39	1.25
26	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	紫金矿业	2899 HK	香港联合交易所	中国香港	1,146,000	9,418,258.78	0.84
27	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	中教控股	839 HK	香港联合交易所	中国香港	1,105,000	7,333,083.21	0.65
28	MAOYAN ENTERTAINMENT	猫眼娱乐	1896 HK	香港联合交易所	中国香港	852,800	5,834,448.26	0.52

注：本基金对以上证券代码采用彭博代码即 BB Ticker。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	106,322,881.71	8.85
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	23,659,974.86	1.97
2	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	94,588,799.57	7.88
3	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1308 HK	59,128,394.23	4.92
4	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1088 HK	56,630,217.36	4.72
5	KUAISHOU-W	1024 HK	55,222,948.92	4.60
6	JD.comInc.	9618 HK	54,558,108.11	4.54
7	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	54,092,729.28	4.50
8	CNOOC LTD	883 HK	53,985,534.70	4.49
9	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	3898 HK	50,685,409.93	4.22
10	CHINA TELECOM CORP LTD-H	728 HK	49,919,544.83	4.16

11	Genscript Biotech Corp	1548 HK	49,320,349.02	4.11
12	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1929 HK	49,260,922.22	4.10
13	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2388 HK	47,874,786.86	3.99
14	PINDUODUO INC-ADR	PDD US	47,005,148.28	3.91
15	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	38,789,298.02	3.23
16	LI NING CO LTD	2331 HK	36,507,497.05	3.04
17	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	35,545,075.70	2.96
18	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	6865 HK	35,295,610.51	2.94
19	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2330 TT	33,010,209.58	2.75
20	MEITUAN DIANPING	3690 HK	29,360,302.03	2.44
21	BYD CO LTD-H	1211 HK	27,475,381.30	2.29
22	Morimatsu International Holdin	2155 HK	25,917,979.49	2.16
23	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	24,964,510.21	2.08
24	Trip.com Group Ltd	TCOM US	24,622,235.37	2.05

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。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	316 HK	108,007,536.96	8.99
2	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	96,605,544.26	8.04
3	JD.comInc.	9618 HK	63,282,273.24	5.27
4	CHINA MOBILE LTD	941 HK	62,297,794.31	5.19
5	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	60,463,872.21	5.03
6	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1088 HK	58,245,184.66	4.85
7	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	55,969,588.47	4.66
8	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	53,907,705.20	4.49
9	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2388 HK	53,207,958.90	4.43
10	CHINA TELECOM CORP LTD-H	728 HK	47,346,508.68	3.94
11	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1929 HK	47,344,153.97	3.94
12	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	3898 HK	45,195,080.71	3.76
13	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	6865 HK	35,569,812.42	2.96
14	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	354 HK	34,366,019.01	2.86
15	POLY PROPERTY DEVELOPMENT	6049 HK	29,841,620.10	2.48
16	MEITUAN DIANPING	3690 HK	29,218,927.10	2.43
17	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3606 HK	27,929,524.42	2.33
18	Hygeia Healthcare Holdings Co	6078 HK	25,879,430.92	2.15
19	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	1209 HK	22,500,005.13	1.87

20	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	839 HK	21,675,015.79	1.80
----	---------------------------------	--------	---------------	------

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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,367,638,026.95
卖出收入（成交）总额	1,216,537,692.20

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

7.11 投资组合报告附注

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

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。

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。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	217,777.64
2	应收清算款	—
3	应收股利	9,396,576.63
4	应收利息	—
5	应收申购款	2,274,736.10
6	其他应收款	24,716,530.70
7	待摊费用	14,888.97
8	其他	—
9	合计	36,620,510.04

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.11.6 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 (%)
119,900	4,956.96	199,293,680.30	33.53	395,045,477.83	66.47

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	750,100.14	0.126207

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

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年9月22日） 基金份额总额	291,092,562.55
本报告期期初基金份额总额	596,968,770.58

本报告期基金总申购份额	110,294,160.45
减：本报告期基金总赎回份额	112,923,772.90
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	594,339,158.13

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

本基金本报告期末更换会计师事务所。

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 (%)	
China International Capita	1	627,556,213.77	24.28	598,425.14	23.44	—

l Corporation Limited						
Haitong International Securities Company Limited	1	483,641,677.72	18.72	500,746.10	19.61	-
United Bank of Switzerland	1	202,320,751.25	7.83	202,320.73	7.92	-
JP Morgan	1	178,931,391.61	6.92	268,397.08	10.51	-
Citigroup Global Markets Asia Limited	1	157,180,377.86	6.08	157,180.40	6.16	-
CLSA	1	145,763,240.46	5.64	145,763.25	5.71	-
Credit Suisse Hong Kong Limited	1	142,883,774.88	5.53	142,883.77	5.60	-
国盛证券有限责任公司	1	87,038,981.59	3.37	69,631.35	2.73	-
国海证券股份有限公司	1	76,130,042.99	2.95	60,903.68	2.39	-
中国银河证券股份有限公司	1	74,846,581.84	2.90	59,877.28	2.35	-
兴业证券股份有限公司	1	60,605,500.10	2.35	48,484.01	1.90	-
中信证券股份有限公司	3	59,965,108.68	2.32	47,971.84	1.88	-
天风证券股份有限公司	1	57,848,369.68	2.24	46,278.44	1.81	-
海通证券股份有限公司	1	47,062,975.45	1.82	37,650.43	1.47	-
瑞银证券有限责任公司	1	35,875,517.28	1.39	28,700.73	1.12	-
长城证券股份有限公司	1	35,374,405.90	1.37	28,300.06	1.11	-
Masterlink	1	32,170,697.05	1.24	38,604.70	1.51	-
中国国际金融股份有限公司	2	28,984,548.50	1.12	23,187.78	0.91	-
华创证券有限责任公司	1	19,014,590.99	0.74	15,211.89	0.60	-
中信建投证券股份有限公司	2	12,343,747.77	0.48	9,874.82	0.39	-
Yuanta securities company limited	1	11,113,565.11	0.43	16,670.29	0.65	-
方正证券股份有限公司	2	5,911,658.81	0.23	4,729.11	0.19	-
安信证券股份有限公司	1	1,611,999.86	0.06	1,289.57	0.05	-
China Renaissance	1					-
Goldman Sachs	1					-
ICBC International Holdings Limited	1					-
中银国际证券股份有限公司	1					-
东方财富证券股份有限公司	2					-
招商证券股份有限公司	4					本期新增 1 个
太平洋证券股份有限公司	1					-
平安证券股份有限公司	1					-
北京高华证券有限责任公司	1					-
第一创业证券股份有限公司	1					-
东方证券股份有限公司	3					-
东亚前海证券有限责任公司	1					-
广发证券股份有限公司	1					-
国都证券股份有限公司	1					-
国金证券股份有限公司	1					-
国泰君安证券股份有限公司	1					-

恒泰证券股份有限公司	1					-
华西证券股份有限公司	1					-
民生证券股份有限公司	1					-
申港证券股份有限公司	1					-
申万宏源证券有限公司	1					-
中航证券股份有限公司	2					本期 新增 1 个
中泰证券股份有限公司	1					-
瑞信证券（中国）有限公司	2	-	-	-	-	-

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		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例 (%)	成交金额	占当期权 证成交总 额的比例 (%)	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例 (%)
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

United Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morgan	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
Masterlink	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
Yuanta securities company limited	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
China Renaissance	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBC International Holdings Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞信证券（中国）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
2	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
3	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
4	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
5	关于景顺长城大中华混合型证券投资基金 2022 年境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）和赎回业务安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-04
6	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
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	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	景顺长城大中华混合型证券投资基金 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	景顺长城大中华混合型证券投资基金	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-26

	境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告		
12	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
13	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-18
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-25
15	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-25
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	2022-03-04
17	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
18	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
19	景顺长城大中华混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-28
20	景顺长城基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司和北京唐鼎耀华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	2022-04-01
21	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
22	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-12
23	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-13
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-16
25	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
26	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
27	景顺长城大中华混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
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	景顺长城基金管理有限公司关于终止上海朝阳永续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	2022-04-27
30	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-29
31	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-05
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	2022-05-06
33	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
34	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
35	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公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-26
36	关于景顺长城大中华混合型证券投资基金人民币份额新增宁波银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”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	2022-06-09
37	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-10
38	关于旗下部分基金新增中国人寿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	2022-06-15
39	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
40	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24
41	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	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

无。

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大中华股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城大中华混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城大中华混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

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