

景顺长城中证港股通科技交易型开放式指  
数证券投资基金发起式联接基金  
2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 1 月 20 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 10 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 景顺中证港股通科技 ETF 联接  |
| 基金主代码      | 016495  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2022 年 9 月 1 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 16,123,459.57 份   |
| 投资目标       | 本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。  |
| 投资策略       | 本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以达到投资目标。当本基金申购、赎回和买卖目标 ETF，或基金自身的申购、赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金管理人会在 10 个交易日内对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。<br>在正常情况下，本基金力争相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。 |
| 业绩比较基准     | 中证港股通科技指数（人民币）收益率*95%+人民币活期存款税后利率×5%  |
| 风险收益特征     | 本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金为股票型指数基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收  |

|                 |  |                    |
|-----------------|--|--------------------|
|                 | 益特征。<br>本基金如投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |                    |
| 基金管理人           | 景顺长城基金管理有限公司   |                    |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司   |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 景顺中证港股通科技 ETF 联接 A   | 景顺中证港股通科技 ETF 联接 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 016495   | 016496             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 11, 852, 707. 22 份   | 4, 270, 752. 35 份  |

### 2.1.1 目标基金基本情况

|              |                           |
|--------------|---------------------------|
| 基金名称         | 景顺长城中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码        | 513980                    |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                    |
| 基金合同生效日      | 2021 年 6 月 21 日           |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所                   |
| 上市日期         | 2021 年 7 月 2 日            |
| 基金管理人名称      | 景顺长城基金管理有限公司              |
| 基金托管人名称      | 招商银行股份有限公司                |

### 2.1.2 目标基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。  |
| 投资策略 | <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金以中证港股通科技指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。</p> <p>2、股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>3、股票期权投资策略</p> <p>本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。若相关法律法规发生变化时，基金管理人期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>本基金的存托凭证投资将根据本基金的投资目标和上述股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，通过定性和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>5、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>6、可转换债券投资策略</p> <p>A) 相对价值分析；B) 基本面研究；C) 估值分析</p> <p>7、融资及转融通证券出借业务投资策略</p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证港股通科技指数（人民币）指数收益率。  |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p> <p>本基金主要通过港股通投资于香港联交所上市的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。</p>  |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2022年10月1日-2022年12月31日） |                    |
|-----------------|-----------------------------|--------------------|
|                 | 景顺中证港股通科技 ETF 联接 A          | 景顺中证港股通科技 ETF 联接 C |
| 1. 本期已实现收益      | -2,383.85                   | -883.33            |
| 2. 本期利润         | 1,753,624.09                | 438,198.03         |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1644                      | 0.1957             |
| 4. 期末基金资产净值     | 12,344,946.18               | 4,447,291.33       |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0415                      | 1.0413             |

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、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、本基金基金合同生效日为2022年9月1日。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺中证港股通科技ETF联接A

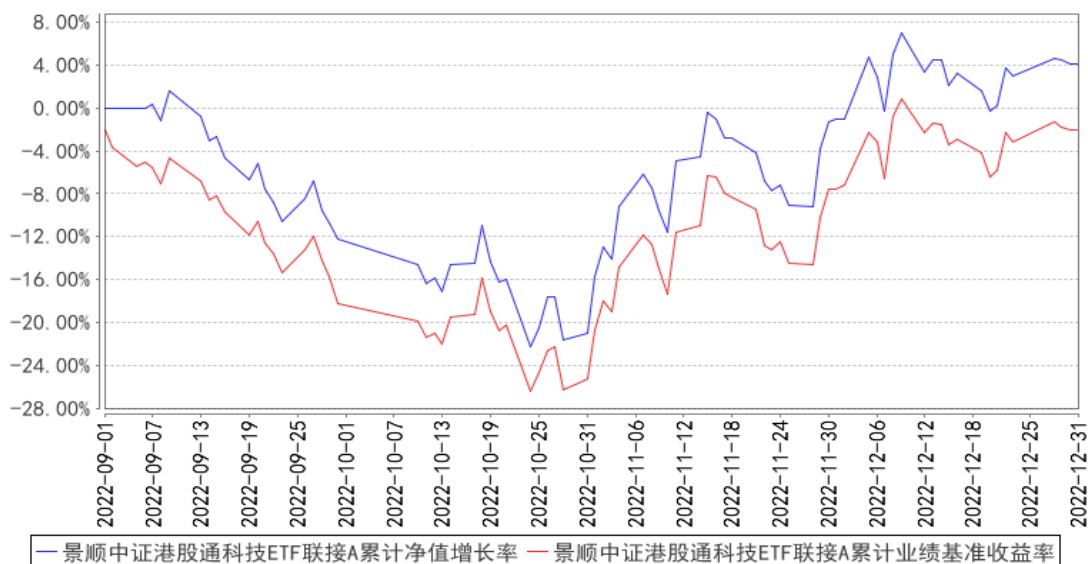
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 18.65% | 3.00%     | 19.74%     | 2.97%         | -1.09% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.15%  | 2.75%     | -2.09%     | 2.75%         | 6.24%  | 0.00% |

景顺中证港股通科技ETF联接C

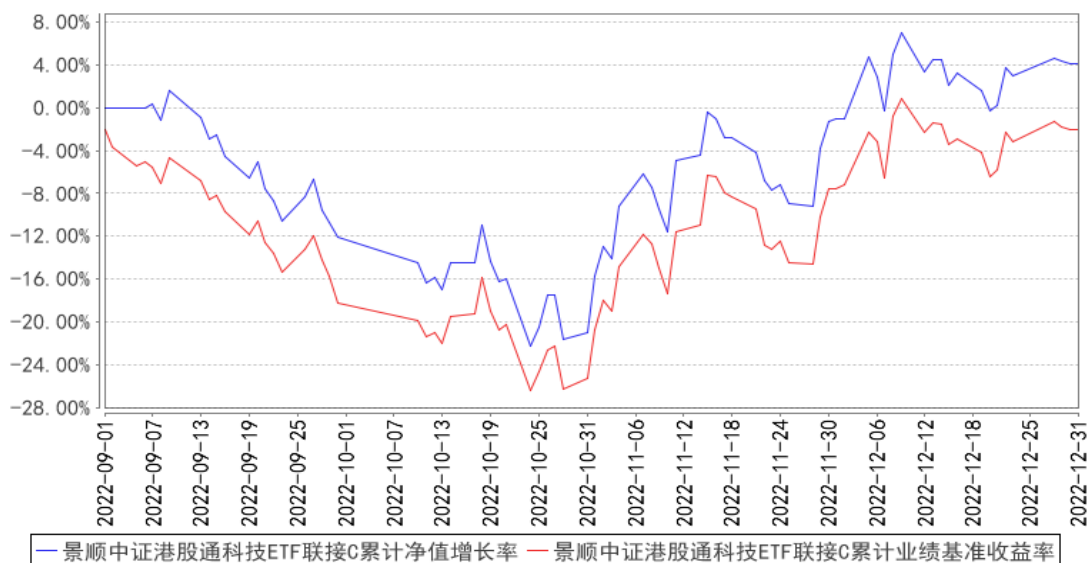
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 18.52% | 3.00%     | 19.74%     | 2.97%         | -1.22% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.13%  | 2.75%     | -2.09%     | 2.75%         | 6.22%  | 0.00% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

景顺中证港股通科技ETF联接A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



景顺中证港股通科技ETF联接C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：本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自2022年9月1日基金合同生效日起6个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2022年9月1日）起至本报告期末不满一年。

### 3.3 其他指标

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务         | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|------------|-------------|------|--------|---|
|     |            | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 张晓南 | 本基金的基金经理   | 2022年9月1日   | -    | 12年    | 经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020年2月加入本公司，自2020年4月起担任ETF与创新投资部基金经理。具有12年证券、基金行业从业经验。 |
| 金璜  | 本基金的基金经理助理 | 2022年10月13日 | -    | 6年     | 工学硕士，CFA。曾任美国Altvest Personal Wealth Management（艾福斯特个人财富管理）投资部量化研究员，Morgan Stanley（美国摩根士丹                                   |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 利) 风险管理部信用风险分析员。2018 年 7 月加入本公司, 历任风险管理部经理、ETF 与创新投资部研究员, 现任基金经理助理。具有 6 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。

#### 4.1.1 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合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》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 公平交易专项说明

##### 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 12 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年 11 月工业增加值当月同比增长 2.20%, 前值 5.00%; 当月环比增长-0.31%, 短期经济表现受到了一定影响, 但当前已经看到了明显的好转迹象。11 月 PMI 指数为 48.00, 10 月后经济

再次受到冲击，但预计整体在 2-3 个月后恢复。11 月 PPI 同比增长-1.30%，前值-1.30%，环比增长 0.10%；CPI 同比增长 1.60%，前值 2.10%，环比增长-0.20%，整体通胀比较温和。11 月 M2 同比增长 12.40%，M1 同比增长 4.60%，社会融资规模存量同比增长 10.00%，政府部门缓慢加杠杆以托底经济。11 月末外汇储备 3.12 万亿美元，当前外汇储备逐渐多元化。当前海外美联储加息节奏逐渐缓和，市场预期 2023 年会有比较宽松的全球流动性环境。同时叠加地缘政治关系逐渐缓和，中概股审计风险初步消除，从港股投资的角度来看，当前已经开始从投资者风险偏好恢复转向估值修复，且在随后可能逐渐看到盈利改善，当前时间点上港股市场具有比较明显的投资性价比。2022 年四季度海外市场逐渐恢复，标普 500、纳斯达克 100、FTSE 100、DAX、CAC 40、恒生指数、恒生科技的收益率分别为 7.08%、-0.29%、8.09%、14.93%、12.35%、14.86%和 19.67%。

本基金是景顺长城中证港股通科技 ETF 的联接基金，主要投资于景顺长城中证港股通科技 ETF。报告期内，本基金结合申购赎回情况进行日常操作，力争控制跟踪误差和跟踪偏离度在较低的水平上。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2022 年 4 季度，景顺中证港股通科技 ETF 联接 A 类份额净值增长率为 18.65%，业绩比较基准收益率为 19.74%。

2022 年 4 季度，景顺中证港股通科技 ETF 联接 C 类份额净值增长率为 18.52%，业绩比较基准收益率为 19.74%。

报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值为 0.36%，跟踪误差（年化）为 7.15%，超过限制。由于指数汇率与估值汇率日期存在不匹配，本基金存在跟踪误差较大的问题。经过汇率调整后，本基金跟踪误差满足合同要求。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目     | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|--------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | -             | -            |
|    | 其中：股票  | -             | -            |
| 2  | 基金投资   | 15,776,985.60 | 88.84        |
| 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      | 1,401,032.03  | 7.89   |
| 8 | 其他资产              | 580,980.05    | 3.27   |
| 9 | 合计                | 17,758,997.68 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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股票投资。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 5.4 报告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。

## 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告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

| 序号 | 基金名称           | 基金类型    | 运作方式        | 管理人          | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------------|---------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| 1  | 景顺长城中证港股通科技ETF | 股票型指数基金 | 交易型开放式(ETF) | 景顺长城基金管理有限公司 | 15,776,985.60 | 93.95        |

## 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

为了更好地实现投资目标，基金还有权投资于股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生工具。

基金投资股指期货、股票期权等衍生工具将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货、股票期权合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。基金还可适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回以及股指期货、股票期权之间的投资操作，以更好地跟踪标的指数。

## 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

## 5.12 投资组合报告附注

### 5.12.1 本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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.12.2 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。

### 5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 2,303.07   |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 578,676.98 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |

|   |    |            |
|---|----|------------|
| 8 | 合计 | 580,980.05 |
|---|----|------------|

#### 5.12.4 报告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。

#### 5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 5.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 景顺中证港股通科技 ETF 联接 A | 景顺中证港股通科技 ETF 联接 C |
|---------------------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 10,008,719.51      | 441,993.12         |
| 报告期期间基金总申购份额              | 2,362,985.55       | 10,616,665.16      |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 518,997.84         | 6,787,905.93       |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                  | -                  |
| 报告期期末基金份额总额               | 11,852,707.22      | 4,270,752.35       |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目                       | 景顺中证港股通科技 ETF 联接 A | 景顺中证港股通科技 ETF 联接 C |
|--------------------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 10,000,472.27      | -                  |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -                  | -                  |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -                  | -                  |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 10,000,472.27      | -                  |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 62.02              | -                  |

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期末运用固有资金投资本基金。

## §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,472.27 | 62.02           | 10,000,000.00 | 96.17           | 3年         |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -               | -             | -               | 不适用        |
| 基金经理等人员     | -             | -               | -             | -               | 不适用        |
| 基金管理人股东     | -             | -               | -             | -               | 不适用        |
| 其他          | -             | -               | -             | -               | 不适用        |
| 合计          | 10,000,472.27 | 62.02           | 10,000,000.00 | 96.17           | -          |

注：发起份额总数为不包含利息的认购份额。

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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              | 20221001-20221231      | 10,000,472.27 | -    | -          | 10,000,472.27 | 62.02   |

#### 产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的20%的情况，可能会出现如下风险：

#### 1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

#### 2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，

亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金募集注册的文件；

2、《景顺长城中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》；

3、《景顺长城中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》；

4、《景顺长城中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》；

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。

### 10.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 10.3 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  
2023 年 1 月 20 日