

景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	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	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
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	20
§ 5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
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	21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	21
§ 6 审计报告	21
6.1 审计报告基本信息	21
6.2 审计报告的基本内容	21
§ 7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表	23
7.2 利润表	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	27

§ 8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	56
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	56
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	56
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
8.12 投资组合报告附注.....	57
§ 9 基金份额持有人信息	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	59
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	59
§ 10 开放式基金份额变动	59
§ 11 重大事件揭示	59
11.1 基金份额持有人大会决议.....	59
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
11.4 基金投资策略的改变.....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
11.8 其他重大事件.....	63
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	69
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
§ 13 备查文件目录	69
13.1 备查文件目录.....	69
13.2 存放地点.....	70
13.3 查阅方式.....	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城环保优势股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城环保优势股票
场内简称	无
基金主代码	001975
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 月 15 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,873,581,012.93 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金依托景顺长城研究团队的研究成果，持续深度挖掘具有环保优势的上市公司，分享其在中国经济增长的大背景下的绿色、高效可持续增长，以实现基金资产的长期资本增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略：本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>2、股票投资策略：本基金通过定性与定量相结合的积极投资策略，自下而上地精选价值被低估并且具有良好基本面的具备环保优势的股票构建投资组合。</p> <p>（1）环保优势企业的界定： 随着经济社会的发展，人类社会与环境的协调发展，生态环境的保护和建设日益重要。本基金将充分挖掘经济社会发展中具备 1、环保产业链优势；2、绿色经济优势；3、效率社会优势；4、可持续发展优势的四大环保优势企业的主题投资机会，通过投资以上主题企业，推动经济社会发展与环境保护矛盾得到有效化解，推动人类社会与自然环境和谐共存。</p> <p>（2）个股投资策略： 按照上述“环保优势企业的界定”中，本基金将采取“自下而上”的方式，依靠定量与定性相结合的方法精选个股，充分发挥基金管理人的研究优势，利用基金管理人股票研究数据库（SRD）对企业内在价值进行深入细致的分析，并进一步挖掘出具有竞争优势的上市公司股票进行投资。</p> <p>3、债券投资策略：债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>4、中小企业私募债投资策略：对单个券种的分析判断与其它信用类</p>

	固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金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、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地调研和分析。
业绩比较基准	中证环保产业指数收益率*40% + 沪深 300 指数收益率*40% + 中证全债指数收益率*20%
风险收益特征	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市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	021-60637111
传真	0755-22381339	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	李进	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	1,297,517,916.01	144,256,824.96	-121,807,443.73
本期利润	2,322,732,456.02	504,286,877.56	-247,841,034.00

加权平均基金份额本期利润	1.3655	0.7564	-0.4046
本期加权平均净值利润率	53.30%	47.31%	-27.74%
本期基金份额净值增长率	70.41%	56.97%	-20.97%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	2,410,953,337.13	527,333,342.55	180,684,348.14
期末可供分配基金份额利润	1.2868	0.4929	0.2473
期末基金资产净值	6,290,545,349.65	2,108,062,802.12	916,437,464.82
期末基金份额净值	3.357	1.970	1.255
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	235.70%	97.00%	25.50%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，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。

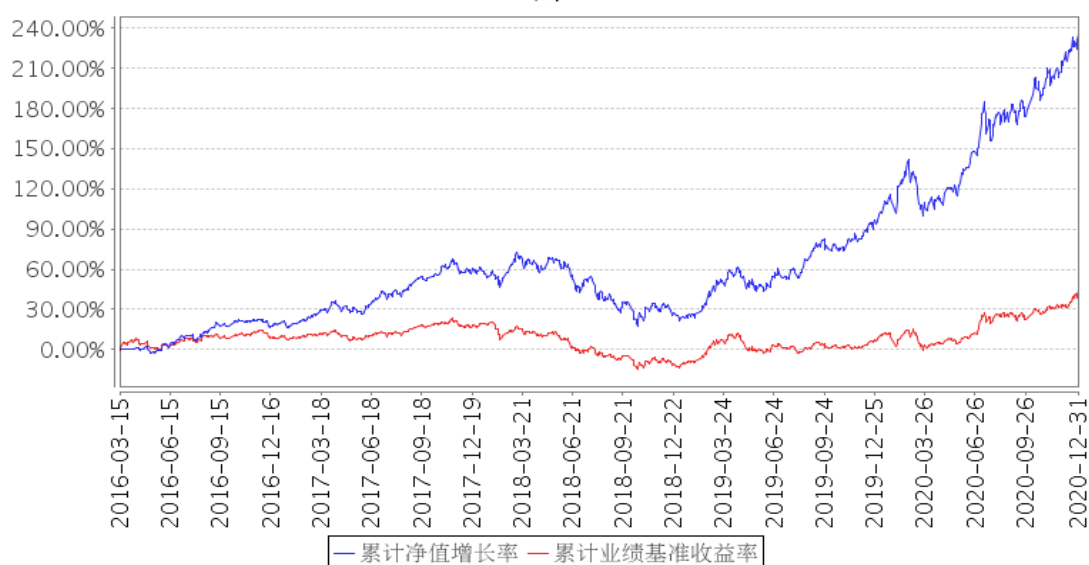
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	20.37%	1.42%	15.80%	1.03%	4.57%	0.39%
过去六个月	34.71%	1.53%	27.10%	1.18%	7.61%	0.35%
过去一年	70.41%	1.57%	32.56%	1.25%	37.85%	0.32%
过去三年	111.40%	1.46%	22.09%	1.12%	89.31%	0.34%
自基金合同生效起至今	235.70%	1.27%	43.21%	0.98%	192.49%	0.29%

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

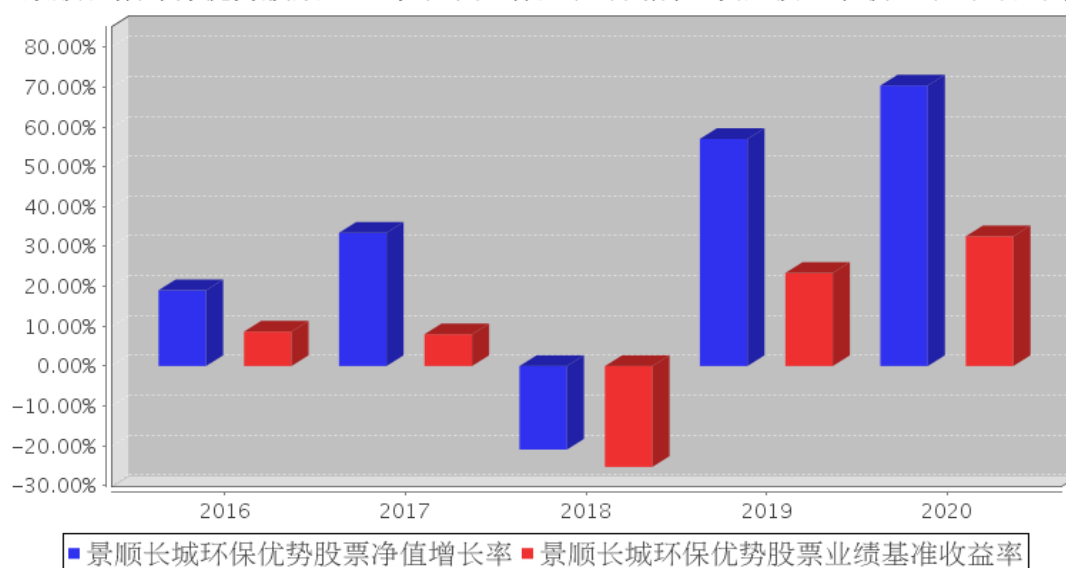
景顺长城环保优势股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：本基金将基金资产的 80%-95% 投资于股票资产，投资于具有环保优势的上市公司发行的股票占非现金资产的比例不低于 80%。权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，将基金资产的 5%-20% 投资于现金和债券等固定收益类品种，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2016 年 3 月 15 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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城环保优势股票基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2016 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2016 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“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。

截至2020年12月31日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理111只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金(QDII)、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证科技传媒通信150交易型开放式指数证

券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证科技传媒通信 150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化小盘股票型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金、景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景泰鑫利纯债债券型证券投资基金、景顺长城智能生活混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金、景顺长城集英成长两年定期开放混合型证券投资基金、景顺长城量化港股通股票型证券投资基金、景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金、景顺长城绩优成长混合型证券投资基金、景顺长城中短债债券型证券投资基金、景顺长城中证沪港深红利成长低波动指数型证券投资基金、景顺长城稳健养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城创新成长混合型证券投资基金、景顺长城景泰纯利债券型证券投资基金、景顺长城养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城弘利 39 个月定期开放债券型证券投资基金、景顺长城品质成长混合型证券投资基金、景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、景顺长城泰申回报混合型证券投资基金、景顺长城科技创新混合型证券投资基金、景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金、景顺长城景泰裕利纯债债券型证券投资基金、景顺长城核心优选一年

持有期混合型证券投资基金、景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城创业板综指增强型证券投资基金、景顺长城成长领航混合型证券投资基金、景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城安鑫回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城弘远 66 个月定期开放债券型证券投资基金、景顺长城价值稳进三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城竞争优势混合型证券投资基金、景顺长城景泰添利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、景顺长城价值边际灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城电子信息产业股票型证券投资基金、景顺长城消费精选混合型证券投资基金、景顺长城中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、景顺长城景颐招利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城顺鑫回报混合型证券投资基金、景顺长城景泰宝利一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金、景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金、景顺长城核心中景一年持有期混合型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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		
杨锐文	本基金的基金经理、股票投资部投资副总监	2016 年 3 月 15 日	-	10 年	工学硕士、理学硕士。曾担任上海常春藤衍生投资公司高级分析师。2010 年 11 月加入本公司，担任研究部研究员，自 2014 年 10 月起担任股票投资部基金经理，现任股票投资部投资副总监兼基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

暂无兼任情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城环保优势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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

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

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在

同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理与绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易现象。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本期暂无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金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，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，公司旗下指数基金因指数成份股调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间虽然存在交易所证券临近交易日同向交易和银行间债券 5 日内反向交易，但结合交易时机及市场交易价格波动分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。

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

本年度，全球新冠疫情进一步加重，导致全球央行被动加大流动性投放，全球股市表现依然强势，A股市场也震荡向上，继续领跑全球市场。基金重仓股表现强势，沪深300、中小板指分别上涨27.21%、43.91%，而创业板指表现较强，上涨64.96%。

本基金始终坚持投资于符合产业趋势的真正的成长股，仓位处于基金合同规定仓位限制中的高仓位（88%-95%）。我们希望投资具有伟大前景的新兴产业企业，并伴随他们的成长，而不是趋势增强、寻求市场热点。未来的胜者一定是不断高强度投入的企业。尽管这些企业不一定是当前的焦点，但是，我们相信厚积薄发才能换取长期的发展。我们始终坚持我们的选择和风格，也会不断优化和改进持仓组合。

由于四季报与年报相隔较近，我们的观点没有任何的改变，因此，报告内容与四季报保持一致，我们继续坚守我们的认知和观点进行投资，不改初心。

我们的组合相对新颖，较少大家耳熟能详的个股，其实并不是我们刻意追求差异化。实际上，一方面是我们过去低估了中国地产周期的韧性；另一方面是我们低估了传统核心资产价值重估的烈度和时间长度。这两方面因素让我们错过了很多机会。尽管我们业绩还能持续跑赢市场，但是，不得不承认过去几年投资企业的成长早中期是比较困难，一不小心就会陷入地雷阵。这一路经历了不少挫折，我们一直在反思中进步，努力降低犯错率。随着连续两年的大牛市，我们可以预见2021年的投资难度很大，经历了多年的盐碱地的耕耘，希望我们的方法论有能力应对更难更复杂的股票筛选的挑战。

市场机会以及我们的应对方式

2020年，市场的风格越来越聚焦于龙头核心资产，市场不断衍生各种理论来解释高估值的合理性。但是，从这么多年来看，无论多么好的企业，估值总是有锚的。很多人认为2021年的收益主要赚利润增长的钱，但是，实际上这种可能性并不太大。毕竟估值是快变量，而利润是慢变量。假定快变量不变，依靠慢变量驱动几乎不可能发生。

历史不断在重演，当年美国漂亮50演绎过相同的逻辑。我们现在翻查当年美国漂亮50的名单，会发现这50家公司大部分今天还活着，而且依然是各自领域中世界最强公司之一。这些公司中出现地雷，以及停止增长的情况并不多。造成它们下跌的最大原因还是过高的估值，使得这些公司很长时间（73年-80年）跑输市场以消化高估值。考虑到未来很长时间的流动性充裕，现在的龙头核心资产出现大幅调整的可能性并不大，更大的概率是通过长期横盘来消化估值下降。

美国漂亮50去泡沫化的过程，市场风格从大盘转向了估值更便宜的中盘。我们并不确定A

股未来是否会这么转变，但是，现在的确估值分化已经到了前所未有的阶段。就当前而言，我们认为在合理估值之上寻找潜在空间较大的成长股是应对未来复杂形势比较好的方式。我们认为市场的机会并不是来自 5% 高估值的抱团股，更多来自于剩余的 95% 股票。这里并不是说，剩余的 95% 股票会有系统性机会，而是机会可能诞生于这些股票中。这意味着未来赚钱难度大大增加，毕竟筛选难度大幅上升。

我们如何从中挖掘机会呢？首先，我们希望这些企业的行业处在时代的风口，新冠疫情全球蔓延、老龄化越来越严重和地缘政治越来越复杂，这意味着未来的十年不同于过往的十年，这都是我们选择行业的时候所必须要考虑的。其次，我们希望企业有较大的潜在市值空间；最后，我们希望企业有强大的生命力。简言之，我们希望在合理估值上洞察未来，希望投资符合产业趋势的具备强大生命力的企业。

除了上述在符合产业趋势的行业选取优秀的企业之外，我们也会投资具有杰出的管理层和企业家精神的企业。这些企业所处的行业并不一定吸引人，或者企业处于阶段性的瓶颈期，但是，企业管理层愿意为长期的成长做出矢志不渝的投入，管理层有远大的目标，脚踏实地地为未来投入，追求更远的价值创造。这种企业往往愿意牺牲短期利润或短期增长为更长期的增长铺垫和投入，我们相信这些管理层会未雨绸缪、顺应时代变革。我们会以更长期的心态对待它的成长，而并不会苛求当前利润或增长。

我们希望寻找 15-20 年前的格力、美的，只是说明我们希望投资企业成长的早中期。但是，成长过程是断断续续的片段连接的，我们需要在这个过程中不断观察、审视企业的生命力。我们不可能一开始就为未来 10-20 年的成长买单。我们努力洞察企业在未来 3-5 年的潜在增长空间，而更远的周期评估是超出我们能力范围的。因此，我们的估值体系有上限。我们认为，科技在发展，时代在进步，组织机构和体制都在不断变革，世界是复杂多变的，我们很难一眼看到企业的终点，企业的生老病死是常态，并不存在那么多基业长青的企业。有人统计过吉姆·柯林斯《基业长青》的 18 家公司，20 年间，只有 8 家确认了基业长青，战胜了市场和同业。在时代的变革面前，时间不一定有那么多朋友。我们更希望持续观察和评估企业的生命力，在合理的估值范围内分享到成长的收益。

目前符合产业趋势的新兴产业龙头股大多处于相对高的估值状态，甄别难度大大增加。但是，新兴产业一直处于变化中，龙头不一定是定势的，我们需要深入了解产业，通过产业切入的方式提升我们的致胜率。

关于投资中的犯错

某重仓股暴跌对我们的组合净值有一定影响，但因为我们的组合是相对分散的，个股暴跌对

我们损伤不会太大，这就是为何我们一直坚持多层次的投资组合的原因。但个股暴跌对我们来说也是很痛苦的，有时候黑天鹅事件很难预测，这种情况尤其对我们投资企业成长的早中期更为常见。投资早中期容易有一定的犯错率，我们一直尝试努力降低风险，提升我们的致胜率，让这种事情尽可能少发生。

我们相信，独立个体的生命力评估、多层次的投资组合、行业相对分散可以使我们的组合风险可控，在此基础之上，我们努力提升选股的命中率，希望能为投资者带来持续的超额收益。

关于基金的策略容量

随着我管理的基金数量越来越多，我们对不同基金是有明显划分不同策略的。需要特别说明的，我们现在管理的优选、环保优势、创新成长和成长领航等四个基金是基于企业生命力评估的方法论策略。这四个基金会大量投资在企业成长的早中期，市值从 30 亿至 5000 亿不等，市值横跨面很广，组合呈现明显的多层次。我们这种策略容量是相对有限的，需要对规模进行动态关注，努力保持规模与策略容量的匹配度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2020 年度，本基金份额净值增长率为 70.41%，业绩比较基准收益率为 32.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来市场的展望

尽管现在投资者的热情高涨，但是，我对 2021 年的市场是相对谨慎的。我认为，龙头股普遍的高估值导致赚钱难度急剧提升，市场的不确定性因素在于新冠疫情的演变和流动性的变化。然而，这两者又相互作用，新冠疫情越演越烈，直接导致各国央行被迫不断放水，不敢轻易退潮。然而，疫情又对各国的生产和消费带来巨大的冲击和破坏，不断损伤各国居民的资产负债表。天量的放水，又进一步加剧了贫富差距，这体现低迷的全社会零售与火热的奢侈品销售。各国的资产泡沫化又进一步加剧，这可能反向制约政策空间，影响 2021 年的流动性左右摇摆，进一步加剧市场的波动率。

另外，新冠疫情让欧美国家的内部矛盾急剧的爆发，这一系列的变化带来内部矛盾的转移，我国经济和政治面临着严峻的考验和挑战。世界过去的一些定势格局在发生改变，曾经熟悉的全球化进程或许阶段性的出现暂停或逆行的趋势。外部的政治局势或许也会带来局部的黑天鹅事件。

时代背景发生急剧的变化，中美之间的科技制约与反制约将会成为未来十年的主旋律，中美再也不回到过去，竞争与冲突可能是常态，科技奋进成为唯一的崛起路径，这是全新的时代。尽管前路充满荆棘和坎坷，我们唯有相信国运昌盛，相信中国人集体的智慧一定能攀登科技高峰。

综上所述，我们认为未来的机会更多出自科技股。但是，可能与以往不一样，这次更可能是

硬科技作为主导力量，而非互联网。

互联网是史上增速最快的行业，打破了旧的渠道，大幅提升了商品流通、信息沟通的效率，但同时又带来了新的问题：补贴倾销、捆绑销售、流量垄断、隐私泄露、大数据杀熟……过去，每一波科技浪潮都会改变世界，然后受到监管。互联网已经生长成世界的一部分，随着各国政府越来越重视互联网的垄断问题，监管政策不断推出，互联网正式进入强监管的年代。从过去银行进入强监管的过程可以预判强力监管互联网的速度将会不断加快，这对互联网巨头带来的影响将是深远的。

但这并不代表我们不再看好互联网。监管打破垄断对创新并不一定是坏事，可能刺激更大范围的创新。美国的反垄断史证明了，规范 IBM 对于个人电脑的垄断，极大地加速了 PC 生态的发展；迫使微软放弃对软件的捆绑销售，也促使了 Google、Facebook 等新兴巨头的崛起。虽然现阶段而言，强监管对互联网巨头的股价并不是什么好事，但是，可能又因此促进了新的创新，又诞生一批新生的互联网公司。整体而言，我们对互联网进入强监管时代保持谨慎态度，但是，变化并非坏事，可能衍生更多的投资机会，我们时刻关注且努力拥抱互联网。

我们未来最看好以下几个方向：电动智能汽车、半导体及自主可控、军工、创新科技产品与中国品牌的崛起。

电动智能汽车

过去 40 年的技术革命，本质上都是计算机革命的延伸。计算机相互的连接让世界进入互联网时代，计算机连接手机让世界进入移动互联网时代，这是过去两次改变世界的革命。2020 年，计算机连接汽车带来的智能电动车革命已经悄然发生了。与以往的革命不一样，中国的智能电动车产业链在起步阶段就具有全球竞争力，中国智能电动车产业链不仅有完整的产业链，还有足够大的产业规模，全球的汽车品牌都在中国寻找供应商。随着华为全面入局汽车，更将全面提升中国车企的智能化水平。华为的入局也将全面加速中国电动智能化的进程。电动车是中国少数在爆发初期就具备产业链优势的产业，我们可以清晰预见中国产业链公司可以充分分享这次大浪潮红利。

这或许是我们未来十年见证的少数十倍以上量级的产业机会。这或许将开启中国汽车品牌正式走向世界之路。过去，中国的自主品牌汽车一直被压制在 15 万元及以下的市场，中国车企在智能电动车上正式进入利润最丰厚的 20-50 万元的市场，打破过去合资品牌和进口品牌在这个价位的垄断。

诚然，无论中美的电动智能汽车产业链在过去一段时间都实现了巨大的涨幅，整体估值都非常高。我们认为未来的表现将会出现明显的分化，但是，这种时代的革命产业的泡沫化将是常态。虽然我们之前也一直谈担忧高估值，更多担心的是相对成熟的传统行业的高估值，然而，对于婴

儿期的行业，泡沫将会是常态，长期潜在市值空间才是我们衡量泡沫的标准。我们敬畏泡沫，但是，也不会因为局部的泡沫而拒绝拥抱一个时代。

半导体及自主可控

华为在 8 月中旬遭遇全面制裁，海思半导体被迫走向 IDM，新冠疫情和华为被制裁都对半导体的格局带来深远的影响，半导体的自主可控加速前行，这是中国半导体行业充满困难的阶段，同时对很多企业而言又是充满机会的阶段。中国半导体的投资机会和风险并存，需要我们更加努力认知产业，做出前瞻性的判断。

中国各行各业的自主可控全面加速，自主可控不局限于半导体，还包括软件、新材料、高端仪器仪表等。

军工

当今的世界格局，正面临着“百年未有之大变局”，外部环境正在发生着深刻且复杂的变化，“去全球化”、保护主义重新抬头，新冠疫情、中美之间的摩擦带来各种变数，这些变数都会刺激军工的加速发展。军工的发展并不是为了战争，而是为了不战。在冲突与摩擦的大背景之下，军工的加速发展是必然的。

创新科技产品与中国品牌崛起

中国企业会逐步从中国制造迈向中国创新，中国的科技和消费品牌将会逐步走向世界舞台。我们看到越来越多的中国企业从微笑曲线的中间点向两边延展，深入到产品的设计和品牌的打造，获取价值链条里更丰厚的一段。过去这样的企业更多地诞生在家电、食品饮料等相对而言制造壁垒比较低的行业，但未来我们将会看到越来越多的企业在机器人、电动车、机械设备、仪器仪表等高精尖领域也打造出全球性的品牌。

当前，不少热门行业和公司出现了非常明显的泡沫化。我们相信再好的行业与公司都是受万有引力牵引的，不可能没有估值锚。在泡沫面前，我们始终保持敬畏心态，重视潜在收益与潜在风险的评估。但是，我们也不会因为局部的泡沫而拒绝拥抱一个时代。毕竟泡沫依然是局部的，估值分化到了历史的极点，我们相信未来还是有各种各样的机会。面对百年不遇的变局，资本市场势必动荡加大，面对未来的大风浪，我们努力把稳船舵，破浪前行。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及

时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI(Key Performance Indicator 主要绩效指标)为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等

方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及其适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截止本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第 60467014_H23 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城环保优势股票型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了景顺长城环保优势股票型证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的景顺长城环保优势股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城环保优势股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	景顺长城环保优势股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，

	<p>在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估景顺长城环保优势股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督景顺长城环保优势股票型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对景顺长城环保优势股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城环保优势股票型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现</p>

	等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	昌华	高鹤
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2021 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城环保优势股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	543,184,749.09	317,665,150.01
结算备付金		4,279,629.61	3,303,586.34
存出保证金		828,640.57	321,340.77
交易性金融资产	7.4.7.2	5,606,324,072.31	1,803,756,480.14
其中：股票投资		5,606,324,072.31	1,802,877,580.14
基金投资		-	-
债券投资		-	878,900.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	209,475,634.22	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	91,881.50	62,970.01
应收股利		-	-
应收申购款		12,661,947.61	20,870,549.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		6,376,846,554.91	2,145,980,076.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		48,637,328.18	11,518,680.81
应付赎回款		25,789,082.98	22,214,039.93

应付管理人报酬		7,087,735.11	2,291,337.56
应付托管费		1,181,289.18	381,889.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,190,719.48	1,272,119.86
应交税费		-	8.17
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	415,050.33	239,198.79
负债合计		86,301,205.26	37,917,274.72
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,873,581,012.93	1,069,940,523.54
未分配利润	7.4.7.10	4,416,964,336.72	1,038,122,278.58
所有者权益合计		6,290,545,349.65	2,108,062,802.12
负债和所有者权益总计		6,376,846,554.91	2,145,980,076.84

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 3.357 元，基金份额总额 1,873,581,012.93 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城环保优势股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		2,420,690,235.60	528,938,939.57
1. 利息收入		2,901,975.42	1,177,700.33
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,752,384.55	1,116,771.79
债券利息收入		5,575.19	679.92
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		144,015.68	60,248.62
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,375,681,628.12	164,692,453.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,327,121,785.66	157,837,028.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	12,861,810.67	664,288.85
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	35,698,031.79	6,191,136.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	1,025,214,540.01	360,030,052.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	16,892,092.05	3,038,733.10
减：二、费用		97,957,779.58	24,652,062.01
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	64,771,567.46	15,907,591.11
2. 托管费	7.4.10.2.2	10,795,261.19	2,651,265.28
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	22,079,723.74	5,825,485.58
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		20.07	2.46
7. 其他费用	7.4.7.19	311,207.12	267,717.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,322,732,456.02	504,286,877.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,322,732,456.02	504,286,877.56

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城环保优势股票型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,069,940,523.54	1,038,122,278.58	2,108,062,802.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,322,732,456.02	2,322,732,456.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	803,640,489.39	1,056,109,602.12	1,859,750,091.51

其中：1. 基金申购款	3,010,984,894.26	4,451,562,027.93	7,462,546,922.19
2. 基金赎回款	-2,207,344,404.87	-3,395,452,425.81	-5,602,796,830.68
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,873,581,012.93	4,416,964,336.72	6,290,545,349.65
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	730,480,955.40	185,956,509.42	916,437,464.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	504,286,877.56	504,286,877.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	339,459,568.14	347,878,891.60	687,338,459.74
其中：1. 基金申购款	1,116,823,069.09	830,031,163.97	1,946,854,233.06
2. 基金赎回款	-777,363,500.95	-482,152,272.37	-1,259,515,773.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,069,940,523.54	1,038,122,278.58	2,108,062,802.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城环保优势股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1622号文《关于准予景顺长城环保优势股票型证券投资基金注册的批复》的核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城环保优势股票型证券投资基金基金合同》作为发起人于2016年1月12日至2016年3月11日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第60467014_H02号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年3月15日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币256,455,323.47元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币131,541.79元以上实收基金(本息)合计为人民币256,586,865.26元,折合256,586,865.26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,注册登记机构为本基金管理人,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。

本基金将基金资产的80%-95%投资于股票资产,投资于具有环保优势的上市公司发行的股票占非现金资产的比例不低于80%。权证投资比例不超过基金资产净值的3%,将基金资产的5%-20%投资于现金和债券等固定收益类品种,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:中证环保产业指数收益率×40%+沪深300指数收益率×40%+中证全债指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产的分类

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票、债券和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

(2) 金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认金融资产或金融负债，按取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

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

终止确认

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

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

金融资产转移

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要

意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按其估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用相关可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额计入当期费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

(2) 增值税及附加、企业所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债

券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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

（3）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	543,184,749.09	317,665,150.01
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月至 1 年	-	-
存款期限 1 年以上	-	-
其他存款	-	-
合计	543,184,749.09	317,665,150.01

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,331,306,214.46	5,606,324,072.31	1,275,017,857.85

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	4,331,306,214.46	5,606,324,072.31	1,275,017,857.85
项目	上年度末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,553,074,262.30	1,802,877,580.14	249,803,317.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	878,900.00	878,900.00
	银行间市场	-	-
	合计	878,900.00	878,900.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,553,953,162.30	1,803,756,480.14	249,803,317.84

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末的衍生金融资产/负债余额均为零。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	209,475,634.22	-
合计	209,475,634.22	-
项目	上年度末 2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	57,697.86	61,217.45
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,925.90	1,486.60
应收债券利息	-	121.36
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	31,884.94	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	372.80	144.60
合计	91,881.50	62,970.01

7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末的其他资产余额均为零。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,190,085.26	1,272,119.86
银行间市场应付交易费用	634.22	-
合计	3,190,719.48	1,272,119.86

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	46,050.33	20,198.79
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	369,000.00	219,000.00
合计	415,050.33	239,198.79

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,069,940,523.54	1,069,940,523.54
本期申购	3,010,984,894.26	3,010,984,894.26
本期赎回（以“-”号填列）	-2,207,344,404.87	-2,207,344,404.87
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,873,581,012.93	1,873,581,012.93

注：本报告期申购份额包含基金转入份额；本报告期赎回份额包含基金转出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	527,333,342.55	510,788,936.03	1,038,122,278.58
本期利润	1,297,517,916.01	1,025,214,540.01	2,322,732,456.02
本期基金份额交易产生的变动数	586,102,078.57	470,007,523.55	1,056,109,602.12
其中：基金申购款	2,447,373,506.40	2,004,188,521.53	4,451,562,027.93
基金赎回款	-1,861,271,427.83	-1,534,180,997.98	-3,395,452,425.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,410,953,337.13	2,006,010,999.59	4,416,964,336.72

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	2,646,670.62	1,086,422.32
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	93,642.88	25,770.60
其他	12,071.05	4,578.87
合计	2,752,384.55	1,116,771.79

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	6,735,962,695.12	1,722,932,828.39
减：卖出股票成本总额	5,408,840,909.46	1,565,095,799.95
买卖股票差价收入	1,327,121,785.66	157,837,028.44

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	41,909,574.66	4,513,867.98
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	29,041,900.00	3,849,000.00
减：应收利息总额	5,863.99	579.13
买卖债券差价收入	12,861,810.67	664,288.85

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	35,698,031.79	6,191,136.25
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	35,698,031.79	6,191,136.25

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	1,025,214,540.01	360,030,052.60
股票投资	1,025,214,540.01	360,030,052.60
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	1,025,214,540.01	360,030,052.60

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	15,957,973.30	2,825,212.40
基金转换费收入	934,118.75	213,520.70
合计	16,892,092.05	3,038,733.10

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	22,079,723.74	5,825,485.58
银行间市场交易费用	-	-
合计	22,079,723.74	5,825,485.58

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	120,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
债券托管账户维护费	37,200.00	37,200.00
银行划款手续费	33,647.12	20,157.58
其他	360.00	360.00
合计	311,207.12	267,717.58

7.4.7.20 分部报告

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

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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”)	基金管理人股东、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人股东
大连实德集团有限公司	基金管理人股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	261,524,882.47	1.76	501,141,262.59	12.67

7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	243,558.30	1.76	146,729.06	4.60
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	466,713.72	12.67	351,797.24	27.65

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	64,771,567.46	15,907,591.11
其中：支付销售机构的客户维护费	17,021,501.35	3,033,258.15

注：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	10,795,261.19	2,651,265.28

注：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金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。

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

本基金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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期	543,184,749.09	2,646,670.62	317,665,150.01	1,086,422.32

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内均未参与关联方承销的证券投资。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000625	长安汽车	2020年10月22日	2021年4月26日	非公开发行	10.70	19.90	1,300,935	13,920,004.50	25,888,606.50	-
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-

003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300860	锋尚文化	2020年8月6日	2021年2月24日	新股流通受限	138.02	126.67	381	52,585.62	48,261.27	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	新股流通受限	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50	-
300863	卡倍亿	2020年8月11日	2021年2月24日	新股流通受限	18.79	103.22	3,421	64,280.59	353,115.62	-
300864	南大环境	2020年8月13日	2021年2月25日	新股流通受限	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300865	大宏立	2020年8月11日	2021年3月1日	新股流通受限	20.20	37.22	3,311	66,882.20	123,235.42	-
300867	圣元环保	2020年8月12日	2021年3月3日	新股流通受限	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-
300868	杰美特	2020年8月12日	2021年2月24日	新股流通受限	41.26	43.28	593	24,467.18	25,665.04	-
300872	天阳科技	2020年8月14日	2021年2月25日	新股流通受限	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	-
300873	海晨股份	2020年8月14日	2021年3月2日	新股流通受限	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300877	金春股份	2020年8月17日	2021年3月3日	新股流通受限	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300878	维康药业	2020年8月17日	2021年3月3日	新股流通受限	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300879	大叶股份	2020年8月25日	2021年3月1日	新股流通受限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300886	华业香料	2020年9月8日	2021年3月16日	新股流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300887	谱尼测试	2020年9月9日	2021年3月16日	新股流通受限	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300889	爱克股份	2020年9月9日	2021年3月16日	新股流通受限	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年3月18日	新股流通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月17日	新股流通受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020年9月11日	2021年3月24日	新股流通受限	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300893	松原股份	2020年9月17日	2021年3月24日	新股流通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300894	火星人	2020年12月24日	2021年6月30日	新股流通受限	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300895	铜牛信息	2020年9月	2021年3月	新股流	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-

		月 17 日	月 24 日	通受限						
300896	爱美客	2020 年 9 月 21 日	2021 年 3 月 29 日	新股流通受限	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
300898	熊猫乳品	2020 年 10 月 9 日	2021 年 4 月 16 日	新股流通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300900	广联航空	2020 年 10 月 19 日	2021 年 4 月 29 日	新股流通受限	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300902	国安达	2020 年 10 月 22 日	2021 年 4 月 29 日	新股流通受限	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300908	仲景食品	2020 年 11 月 13 日	2021 年 5 月 24 日	新股流通受限	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300909	汇创达	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	新股流通受限	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300911	亿田智能	2020 年 11 月 24 日	2021 年 6 月 3 日	新股流通受限	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300917	特发服务	2020 年 12 月 14 日	2021 年 6 月 21 日	新股流通受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300918	南山智尚	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 22 日	新股流通受限	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 23 日	新股流通受限	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300922	天秦装备	2020 年 12 月 18 日	2021 年 6 月 25 日	新股流通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300925	法本信息	2020 年 12 月 21 日	2021 年 6 月 30 日	新股流通受限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新股流通受限	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300999	金龙鱼	2020 年 9 月 29 日	2021 年 4 月 15 日	新股流通受限	25.70	88.29	12,114	311,329.80	1,069,545.06	-
600893	航发动力	2020 年 12 月 30 日	2021 年 6 月 30 日	大宗交易流通受限	47.21	53.50	560,000	26,437,600.00	29,960,000.00	-
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688093	世华科技	2020 年 9 月 22 日	2021 年 3 月 30 日	新股流通受限	17.55	23.63	4,595	80,642.25	108,579.85	-
688219	会通股份	2020 年 11 月 6 日	2021 年 5 月 18 日	新股流通受限	8.29	13.70	7,336	60,815.44	100,503.20	-
688301	奕瑞科技	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 18 日	新股流通受限	119.60	162.72	2,427	290,269.20	394,921.44	-
688330	宏力达	2020 年 9 月 21 日	2021 年 4 月 29 日	新股流通受限	88.23	75.87	3,573	315,245.79	271,083.51	-

		月 28 日	月 15 日	通受限						
688567	孚能科技	2020 年 7 月 8 日	2021 年 1 月 18 日	新股流通受限	15.90	44.06	51,413	817,466.70	2,265,256.78	-
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2021 年 1 月 4 日	新股流通受限	15.50	17.06	5,468	84,754.00	93,284.08	-
688608	恒玄科技	2020 年 12 月 7 日	2021 年 6 月 16 日	新股流通受限	162.07	272.00	4,179	677,290.53	1,136,688.00	-
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 7 日	新股流通受限	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688698	伟创电气	2020 年 12 月 22 日	2021 年 6 月 29 日	新股流通受限	10.75	15.29	4,751	51,073.25	72,642.79	-

注：上述流通受限证券的“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终可流通日期以上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本期末，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（上年末：0.04%）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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，部分基金资产流动暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人通过由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，并按照合约

规定的重新定价日或到期日进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	543,184,749.09	-	-	-	-	-	543,184,749.09
结算备付金	4,279,629.61	-	-	-	-	-	4,279,629.61
存出保证金	828,640.57	-	-	-	-	-	828,640.57
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,606,324,072.31	5,606,324,072.31
买入返售金融资产	209,475,634.22	-	-	-	-	-	209,475,634.22
应收利息	-	-	-	-	-	91,881.50	91,881.50
应收申购款	-	-	-	-	-	12,661,947.61	12,661,947.61
资产总计	757,768,653.49	-	-	-	-	5,619,077,901.42	6,376,846,554.91
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	25,789,082.98	25,789,082.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,087,735.11	7,087,735.11
应付托管费	-	-	-	-	-	1,181,289.18	1,181,289.18
应付证券清算款	-	-	-	-	-	48,637,328.18	48,637,328.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,190,719.48	3,190,719.48
其他负债	-	-	-	-	-	415,050.33	415,050.33
负债总计	-	-	-	-	-	86,301,205.26	86,301,205.26
利率敏感度缺口	757,768,653.49	-	-	-	-	-	-
上年度末 2019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	317,665,150.01	-	-	-	-	-	317,665,150.01
结算备付金	3,303,586.34	-	-	-	-	-	3,303,586.34
存出保证金	321,340.77	-	-	-	-	-	321,340.77
交易性金融资产	-	-	-	-	878,900.00	1,802,877,580.14	1,803,756,480.14
应收利息	-	-	-	-	-	62,970.01	62,970.01
应收申购款	-	-	-	-	-	20,870,549.57	20,870,549.57
资产总计	321,290,077.12	-	-	-	878,900.00	1,823,811,099.72	2,145,980,076.84
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	22,214,039.93	22,214,039.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,291,337.56	2,291,337.56
应付托管费	-	-	-	-	-	381,889.60	381,889.60
应付证券清算款	-	-	-	-	-	11,518,680.81	11,518,680.81
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,272,119.86	1,272,119.86
应交税费	-	-	-	-	-	8.17	8.17
其他负债	-	-	-	-	-	239,198.79	239,198.79
负债总计	-	-	-	-	-	37,917,274.72	37,917,274.72
利率敏感度缺口	321,290,077.12	-	-	-	878,900.00	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.0%（上年末：0.04%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019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	5,606,324,072.31	89.12	1,802,877,580.14	85.52
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	5,606,324,072.31	89.12	1,802,877,580.14	85.52

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变
----	---------------------------

	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	327,366,971.70	92,551,376.53
	沪深 300 指数下降 5%	-327,366,971.70	-92,551,376.53

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

2. 其他事项

(1) 公允价值

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

各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 5,543,417,372.23 元，划分为第二层次的余额为人民币 62,906,700.08 元，无划分为第三层次的余额（于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 1,797,247,802.67 元，划分为第二层次的余额为人民币 6,508,677.47 元，无划分为第三层次的余额）。

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

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

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

3. 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,606,324,072.31	87.92
	其中：股票	5,606,324,072.31	87.92
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	209,475,634.22	3.28
	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	547,464,378.70	8.59
8	其他各项资产	13,582,469.68	0.21
9	合计	6,376,846,554.91	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,483,722,075.51	71.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	23,841,276.20	0.38
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	316,646,764.84	5.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	537,166,229.07	8.54
J	金融业	203,462,746.20	3.23
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.00

N	水利、环境和公共设施管理业	41,395,772.16	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	48,261.27	0.00
S	综合	-	-
	合计	5,606,324,072.31	89.12

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002352	顺丰控股	3,588,652	316,626,765.96	5.03
2	688169	石头科技	298,088	308,819,168.00	4.91
3	300207	欣旺达	9,920,122	304,646,946.62	4.84
4	002841	视源股份	2,478,608	285,114,278.24	4.53
5	600893	航发动力	4,656,227	273,071,072.45	4.34
6	002049	紫光国微	1,912,416	255,900,384.96	4.07
7	300037	新宙邦	2,376,353	240,962,194.20	3.83
8	688099	晶晨股份	3,018,450	237,642,568.50	3.78
9	000625	长安汽车	9,906,556	214,179,593.98	3.40
10	601318	中国平安	2,339,190	203,462,746.20	3.23
11	300568	星源材质	6,273,594	189,901,690.38	3.02
12	603601	再升科技	13,418,194	183,158,348.10	2.91
13	603515	欧普照明	6,023,673	181,975,161.33	2.89
14	002507	涪陵榨菜	4,033,123	170,601,102.90	2.71
15	300482	万孚生物	1,898,198	169,338,243.58	2.69
16	300073	当升科技	2,367,362	153,523,425.70	2.44
17	300888	稳健医疗	890,273	147,785,318.00	2.35
18	688116	天奈科技	2,336,344	144,853,328.00	2.30
19	300776	帝尔激光	939,830	141,162,466.00	2.24
20	002126	银轮股份	9,940,828	136,885,201.56	2.18
21	603920	世运电路	4,893,121	128,004,045.36	2.03
22	002056	横店东磁	8,406,962	127,701,752.78	2.03
23	300010	豆神教育	12,107,133	118,165,618.08	1.88
24	300001	特锐德	3,666,330	107,643,448.80	1.71
25	603197	保隆科技	3,695,058	103,941,981.54	1.65
26	300378	鼎捷软件	3,744,142	102,027,869.50	1.62
27	688299	长阳科技	3,587,959	89,627,215.82	1.42

28	300616	尚品宅配	1,113,147	88,673,290.02	1.41
29	603788	宁波高发	5,411,359	75,326,117.28	1.20
30	688598	金博股份	256,382	55,450,298.96	0.88
31	300562	乐心医疗	2,445,439	53,530,659.71	0.85
32	688398	赛特新材	903,421	49,868,839.20	0.79
33	300766	每日互动	2,926,164	48,252,444.36	0.77
34	603160	汇顶科技	291,388	45,325,403.40	0.72
35	000888	峨眉山A	6,888,800	41,332,800.00	0.66
36	300580	贝斯特	1,867,248	37,923,806.88	0.60
37	688018	乐鑫科技	208,572	31,000,056.36	0.49
38	002989	中天精装	642,622	23,841,276.20	0.38
39	002664	长鹰信质	800,000	11,944,000.00	0.19
40	688567	孚能科技	51,413	2,265,256.78	0.04
41	688608	恒玄科技	4,179	1,136,688.00	0.02
42	300999	金龙鱼	12,114	1,069,545.06	0.02
43	688301	奕瑞科技	2,427	394,921.44	0.01
44	300863	卡倍亿	3,421	353,115.62	0.01
45	300896	爱美客	473	285,389.28	0.00
46	688330	宏力达	3,573	271,083.51	0.00
47	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.00
48	300865	大宏立	3,311	123,235.42	0.00
49	688093	世华科技	4,595	108,579.85	0.00
50	688219	会通股份	7,336	100,503.20	0.00
51	688600	皖仪科技	5,468	93,284.08	0.00
52	688698	伟创电气	4,751	72,642.79	0.00
53	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.00
54	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.00
55	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
56	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
57	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
58	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
59	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
60	300877	金春股份	569	28,933.65	0.00
61	300868	杰美特	593	25,665.04	0.00
62	300894	火星人	628	23,217.16	0.00
63	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
64	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
65	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
66	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
67	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
68	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
69	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00

70	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
71	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
72	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
73	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
74	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
75	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
76	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
77	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
78	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
79	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
80	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
81	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
82	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
83	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
84	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
85	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
86	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
87	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
88	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
89	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
90	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000625	长安汽车	310,853,968.31	14.75
2	300010	豆神教育	234,706,414.53	11.13
3	300766	每日互动	228,088,263.17	10.82
4	688169	石头科技	207,732,286.00	9.85
5	600893	航发动力	207,388,769.67	9.84
6	601318	中国平安	203,994,578.36	9.68
7	688099	晶晨股份	196,403,832.09	9.32
8	002049	紫光国微	193,474,091.38	9.18
9	603601	再升科技	188,585,127.97	8.95
10	002056	横店东磁	186,631,997.94	8.85
11	300001	特锐德	184,508,788.12	8.75
12	300207	欣旺达	179,634,302.98	8.52
13	300568	星源材质	171,352,017.53	8.13
14	603338	浙江鼎力	168,674,292.13	8.00
15	002507	涪陵榨菜	168,412,433.06	7.99
16	300073	当升科技	162,399,051.50	7.70

17	002841	视源股份	156,018,051.38	7.40
18	601658	邮储银行	153,489,325.87	7.28
19	300482	万孚生物	152,629,654.36	7.24
20	300498	温氏股份	147,722,289.58	7.01
21	002007	华兰生物	147,232,379.07	6.98
22	300562	乐心医疗	146,073,555.82	6.93
23	603160	汇顶科技	142,850,352.14	6.78
24	603920	世运电路	141,253,936.66	6.70
25	300776	帝尔激光	139,132,661.47	6.60
26	300888	稳健医疗	135,261,311.39	6.42
27	300616	尚品宅配	126,713,133.87	6.01
28	002126	银轮股份	124,772,778.75	5.92
29	603515	欧普照明	119,951,757.82	5.69
30	300203	聚光科技	110,887,681.12	5.26
31	300378	鼎捷软件	110,318,444.66	5.23
32	603197	保隆科技	103,663,594.87	4.92
33	002352	顺丰控股	103,599,511.31	4.91
34	600673	东阳光	101,316,958.06	4.81
35	688116	天奈科技	98,224,894.48	4.66
36	000725	京东方 A	95,639,094.00	4.54
37	300580	贝斯特	91,203,390.59	4.33
38	688020	方邦股份	89,088,070.53	4.23
39	688299	长阳科技	84,706,976.67	4.02
40	002382	蓝帆医疗	84,682,736.66	4.02
41	600637	东方明珠	79,317,883.25	3.76
42	002664	长鹰信质	72,064,151.34	3.42
43	688598	金博股份	70,739,565.56	3.36
44	002709	天赐材料	69,567,431.00	3.30
45	300037	新宙邦	66,066,296.05	3.13
46	002965	祥鑫科技	64,833,558.25	3.08
47	600480	凌云股份	64,578,505.95	3.06
48	002558	巨人网络	64,098,325.79	3.04
49	002989	中天精装	64,014,850.54	3.04
50	688018	乐鑫科技	62,523,728.00	2.97
51	002138	顺络电子	59,862,514.24	2.84
52	605009	豪悦护理	56,147,598.59	2.66
53	603239	浙江仙通	54,748,748.35	2.60
54	000888	峨眉山 A	54,491,063.89	2.58
55	300124	汇川技术	53,549,546.83	2.54
56	300604	长川科技	50,858,815.43	2.41
57	688398	赛特新材	50,679,520.89	2.40
58	300383	光环新网	50,298,360.97	2.39

59	300450	先导智能	47,680,900.20	2.26
60	600217	中再资环	44,664,632.46	2.12
61	002303	美盈森	44,146,906.84	2.09
62	300726	宏达电子	43,254,321.80	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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603338	浙江鼎力	330,063,630.44	15.66
2	000625	长安汽车	289,069,886.36	13.71
3	002382	蓝帆医疗	228,386,744.69	10.83
4	603160	汇顶科技	212,818,149.77	10.10
5	002007	华兰生物	208,733,407.98	9.90
6	300073	当升科技	206,220,770.94	9.78
7	300568	星源材质	186,810,238.20	8.86
8	601658	邮储银行	175,445,373.65	8.32
9	300383	光环新网	161,264,615.95	7.65
10	688169	石头科技	155,733,746.28	7.39
11	600673	东阳光	147,179,541.42	6.98
12	000977	浪潮信息	145,418,120.55	6.90
13	300498	温氏股份	138,188,287.94	6.56
14	300207	欣旺达	135,835,243.72	6.44
15	300203	聚光科技	130,756,912.10	6.20
16	002352	顺丰控股	124,214,793.25	5.89
17	603601	再升科技	113,149,329.54	5.37
18	300562	乐心医疗	110,413,868.74	5.24
19	002709	天赐材料	108,313,519.44	5.14
20	300450	先导智能	107,373,655.75	5.09
21	300001	特锐德	104,025,027.01	4.93
22	300413	芒果超媒	103,138,195.11	4.89
23	002056	横店东磁	103,123,837.99	4.89
24	600217	中再资环	100,456,343.81	4.77
25	300482	万孚生物	99,669,327.98	4.73
26	000725	京东方 A	97,392,367.00	4.62
27	002138	顺络电子	94,521,773.90	4.48
28	688002	睿创微纳	91,786,763.87	4.35
29	300124	汇川技术	87,433,423.10	4.15
30	688020	方邦股份	75,052,907.75	3.56
31	002965	祥鑫科技	74,901,264.38	3.55
32	603239	浙江仙通	74,424,650.60	3.53
33	300766	每日互动	72,386,778.84	3.43

34	600480	凌云股份	70,369,510.79	3.34
35	600637	东方明珠	66,939,053.65	3.18
36	002841	视源股份	65,701,568.47	3.12
37	300580	贝斯特	65,444,538.34	3.10
38	603515	欧普照明	64,790,296.83	3.07
39	688598	金博股份	63,725,557.80	3.02
40	300726	宏达电子	62,159,904.28	2.95
41	603197	保隆科技	60,578,110.23	2.87
42	688018	乐鑫科技	60,141,828.43	2.85
43	605009	豪悦护理	57,742,687.16	2.74
44	002558	巨人网络	57,424,443.23	2.72
45	300616	尚品宅配	55,385,761.06	2.63
46	300037	新宙邦	50,791,312.95	2.41
47	600406	国电南瑞	50,585,275.92	2.40
48	002303	美盈森	49,950,917.89	2.37
49	002664	长鹰信质	49,142,532.88	2.33
50	300604	长川科技	48,084,242.09	2.28
51	603103	横店影视	45,432,906.70	2.16
52	688157	松井股份	44,743,191.55	2.12
53	688300	联瑞新材	42,526,692.93	2.02

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,187,072,861.62
卖出股票收入（成交）总额	6,735,962,695.12

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

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

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

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

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。

8.12 投资组合报告附注

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

1、中国平安保险(集团)股份有限公司（以下简称“中国平安”，股票代码：601318）因其子公司中国平安财产保险股份有限公司于2020年8月6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〔2020〕58号)。其因未按车辆实际使用性质承保商业车险行为违反了《保险法》第一百三十五条的规定，被罚款50万元。手续费支出未分摊至各分支机构行为违反了《保险法》第八十六条的规定，被罚款25万元。

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中国平安进行了投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	828,640.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	91,881.50
5	应收申购款	12,661,947.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,582,469.68

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600893	航发动力	29,960,000.00	0.48	大宗交易流通受限
2	000625	长安汽车	25,888,606.50	0.41	非公开流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
237,078	7,902.80	1,096,258,421.74	58.51	777,322,591.19	41.49

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	16,459,518.78	0.88

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	-

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年3月15日） 基金份额总额	256,586,865.26
本报告期期初基金份额总额	1,069,940,523.54
本报告期基金总申购份额	3,010,984,894.26
减：本报告期基金总赎回份额	2,207,344,404.87
本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,873,581,012.93

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于2020年1月22日发布公告，因丁益董事长退休，由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。本基金管理人于2020年9月12日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任李进先生担任本公司董事长。本基金管理人于2020年10月16日发布公告，经深圳市市场监督管理局核准，景顺长城基金管理有限公司法定代表人变更为李进先生。

2、本基金管理人于2020年3月6日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任李黎女士担任本公司副总经理。

3、本基金管理人于2020年5月28日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审

议通过，同意吴建军先生辞去本公司首席信息官一职，聘任张明先生担任本公司首席信息官。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及本基金基金合同、更新招募说明书等规定，经与基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司对本基金参与存托凭证投资修订基金合同等法律文件，包括明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法等，并在基金合同、基金招募说明书（更新）、产品资料概要中增加投资存托凭证的风险揭示。本次修订属于法律法规规定无需召开基金份额持有人大会的事项，修订自 2020 年 11 月 4 日起正式生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 11 月 4 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同等法律文件的公告》。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 5 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 120,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人分管副总经理由于信息技术业务人员未对系统测试结果进行审查，致使公司旗下个别基金出现拉抬股价的异常交易情形，收到深圳证监局监管谈话的决定。本报告期内，本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的	佣金	占当期佣金	

			比例		总量的比例	
中泰证券股份有限公司	2	1,724,245,944.86	11.61%	1,605,788.98	11.61%	本期退租 1 个
光大证券股份有限公司	2	1,677,665,030.70	11.29%	1,562,415.19	11.29%	-
中信证券股份有限公司	3	1,514,722,151.43	10.20%	1,410,660.31	10.20%	-
西藏东方财富证券股份 有限公司	2	1,236,652,696.89	8.32%	1,151,697.49	8.32%	-
广发证券股份有限公司	1	1,131,258,627.89	7.62%	1,053,548.23	7.61%	-
长江证券股份有限公司	1	1,030,075,277.50	6.93%	959,311.95	6.93%	-
国泰君安证券股份有限 公司	1	814,817,711.28	5.49%	758,841.74	5.48%	-
西部证券股份有限公司	2	798,483,392.71	5.38%	743,624.65	5.37%	-
国信证券股份有限公司	2	782,022,118.76	5.26%	728,683.00	5.27%	-
汇丰前海证券有限责任 公司	1	688,919,337.90	4.64%	641,592.82	4.64%	-
中国国际金融股份有限 公司	1	536,644,566.10	3.61%	499,780.94	3.61%	-
中银国际证券股份有限 公司	1	461,285,529.30	3.11%	429,595.80	3.11%	-
中信建投证券股份有限 公司	2	399,269,097.98	2.69%	371,839.77	2.69%	-
招商证券股份有限公司	1	360,535,618.02	2.43%	335,768.56	2.43%	-
华创证券有限责任公司	1	344,954,508.95	2.32%	321,256.34	2.32%	-
东方证券股份有限公司	1	318,004,631.34	2.14%	296,157.90	2.14%	-
方正证券股份有限公司	1	265,325,438.57	1.79%	247,098.21	1.79%	-
渤海证券股份有限公司	2	263,741,318.33	1.78%	245,623.07	1.78%	-
长城证券股份有限公司	2	261,524,882.47	1.76%	243,558.30	1.76%	-
天风证券股份有限公司	1	155,374,554.69	1.05%	144,697.59	1.05%	-
东北证券股份有限公司	1	89,837,504.00	0.60%	83,665.84	0.60%	-

安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
------------	---	---	---	---	---	------

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	951,368.38	2.27%	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	14,049,938.74	33.52%	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-

中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	23,474,990.84	56.01%	-	-	-
长城证券股份有限公司	3,433,276.70	8.19%	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-21
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-21
3	景顺长城基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-22
4	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、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	2020-01-30
5	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、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	2020-01-31
6	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、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	2020-02-03
7	景顺长城基金管理有限公司及全资子公司投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-06
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加长江证券股份有限公司基金申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-17
9	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-06
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中欧钱滚滚基金销售（上海）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	2020-03-10

11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-10
12	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	2020-03-19
13	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-20
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加鼎信汇金（北京）投资管理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	2020-03-25
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司基金转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-25
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-25
17	景顺长城基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-30
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司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	2020-03-31
19	景顺长城基金管理有限公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-07
20	景顺长城基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-08
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加万联证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-10
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万联证券为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-10
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报刊及	2020-04-20

	基金 2019 年年度报告提示性公告	网站	
24	景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2019 年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-20
25	景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-22
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-22
27	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统农业银行渠道暂停支付的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-29
28	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统农业银行渠道恢复支付的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-30
29	景顺长城基金管理有限公司关于终止扬州国信嘉利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	2020-04-30
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在招商银行开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-14
31	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	2020-05-15
32	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增天风证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-19
33	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行股份有限公司定期定额投资最低金额限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-20
34	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员（首席信息官）变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-28
35	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京汇成基金销售有限公司基金申购及转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-01
36	关于景顺长城环保优势股票型证券投资基金参加招商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	2020-06-19
37	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机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	2020-07-01
38	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	2020-07-02

39	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华安证券股份有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-06
40	景顺长城基金管理有限公司关于直销APP交易系统相关服务的提示	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-07
41	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-09
42	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信证券等多家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	2020-07-20
43	景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-21
44	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-21
45	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	2020-07-31
46	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加渤海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	2020-07-31
47	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加申万宏源西部证券有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-17
48	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加申万宏源证券有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-17
49	景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2020 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-24
50	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-24
51	景顺长城环保优势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	2020-08-31
52	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金披露基金产品资料概要（更新）的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-31
53	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在中航证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-10
54	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-12
55	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	2020-09-19
56	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	2020-09-24

	停机维护的公告	网站	
57	关于旗下部分基金新增北京唐鼎耀华基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-25
58	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	2020-09-26
59	关于旗下部分基金新增腾安基金为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购、赎回费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-09
60	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国建设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	2020-10-12
61	景顺长城基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-16
62	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	2020-10-16
63	景顺长城基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型类型的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-21
64	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华鑫证券有限责任公司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	2020-10-23
65	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金投资长安汽车(代码: 000625.SZ)非公开发行的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-24
66	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-27
67	景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-27
68	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	2020-10-30
69	景顺长城基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-03
70	景顺长城基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-04
71	景顺长城环保优势股票型证券投资基	中国证监会指定报刊及	2020-11-04

	金 2020 年第 1 号更新招募说明书	网站	
72	景顺长城环保优势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	2020-11-04
73	景顺长城环保优势股票型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-04
74	景顺长城环保优势股票型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-04
75	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	2020-11-05
76	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	2020-11-13
77	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	2020-11-26
78	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加宁波银行股份有限公司同业基金销售平台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	2020-11-27
79	景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2020 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-30
80	景顺长城环保优势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	2020-11-30
81	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	2020-12-03
82	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加信达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	2020-12-15
83	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大同证券有限责任公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-18
84	关于景顺长城环保优势股票型证券投资基金在天风证券开通基金“定期定额投资业务”及参加基金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	2020-12-22
85	景顺长城基金管理有限公司关于终止盈信基金等公司办理相关业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-22
86	景顺长城基金管理有限公司关于终止北京电盈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	2020-12-24
87	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通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	2020-12-31
88	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报刊及	2020-12-31

	部分基金参加苏州银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	网站	
89	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“2021 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	2020-12-31
90	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	2020-12-31

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及本基金基金合同、更新招募说明书等规定，经与基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司对本基金参与存托凭证投资修订基金合同等法律文件，包括明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法等，并在基金合同、基金招募说明书（更新）、产品资料概要中增加投资存托凭证的风险揭示。本次修订属于法律法规规定无需召开基金份额持有人大会的事项，修订自 2020 年 11 月 4 日起正式生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 11 月 4 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同等法律文件的公告》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城环保优势股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城环保优势股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城环保优势股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城环保优势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。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2021年3月29日