

# 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 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。

普华永道中天会计师事务所（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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
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
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
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.....	56
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
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>58</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
9.4 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
9.5 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
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>59</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>59</b>
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.....	61
11.8 其他重大事件.....	62
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>66</b>
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.....	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>68</b>
13.1 备查文件目录.....	68
13.2 存放地点.....	68
13.3 查阅方式.....	68

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	景顺长城中证科技传媒通信 150ETF
场内简称	科技 150（扩位证券简称：科技 ETF150）
基金主代码	512220
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 7 月 18 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	265,467,642.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2014 年 8 月 19 日

### 2.2 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。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金以中证科技传媒通信 150 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 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。 本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。
业绩比较基准	中证科技传媒通信 150 指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均预期风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，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。

### 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		中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皦阳	许俊
	联系电话	0755-82370388	010-66594319
	电子邮箱	investor@igwfm.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	4008888606	95566	
传真	0755-22381339	010-66594942	
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 1 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 1 号	
邮政编码	518048	100818	
法定代表人	李进	刘连舸	

## 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	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §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	61,570,332.49	-33,066,776.55	-82,759,238.03
本期利润	100,210,903.36	115,242,739.07	-123,209,433.84
加权平均基金份额本期利润	0.3361	0.4438	-0.4813
本期加权平均净值利润率	20.06%	36.48%	-39.35%
本期基金份额净值增长率	23.56%	48.96%	-34.13%
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	-822,809.73	-43,300,237.07	-15,459,181.30
期末可供分配基金份额利润	-0.0031	-0.1912	-0.0610
期末基金资产净值	460,880,994.65	318,205,304.16	239,095,496.48
期末基金份额净值	1.7361	1.4051	0.9433
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	73.61%	40.51%	-5.67%

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、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。

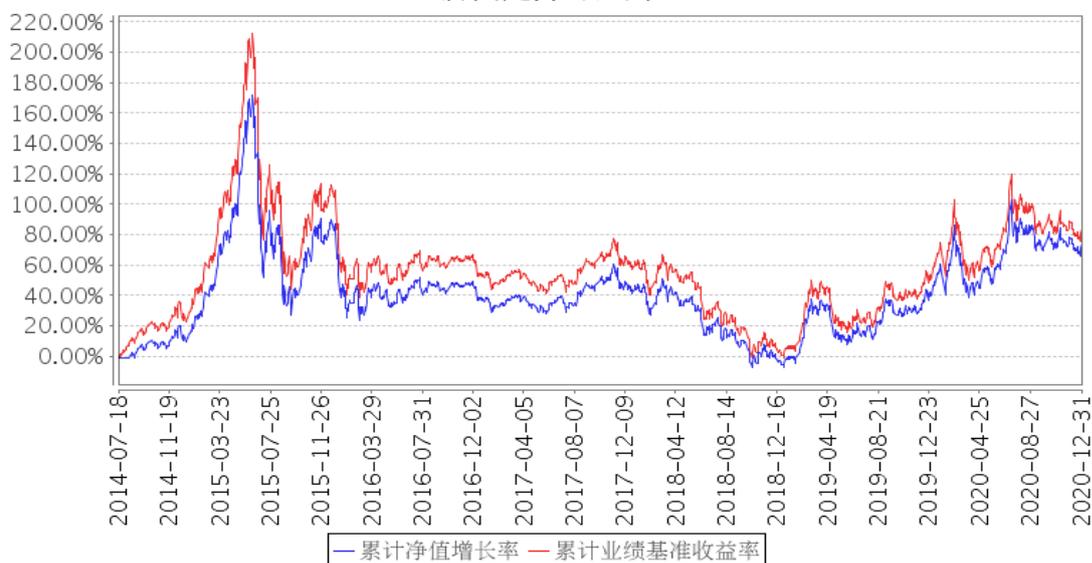
## 3.2 基金净值表现

### 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	1.41%	1.30%	0.84%	1.33%	0.57%	-0.03%
过去六个月	0.82%	1.70%	-1.43%	1.74%	2.25%	-0.04%
过去一年	23.56%	2.07%	20.86%	2.12%	2.70%	-0.05%
过去三年	21.23%	1.90%	15.74%	1.96%	5.49%	-0.06%
过去五年	-4.60%	1.77%	-9.98%	1.82%	5.38%	-0.05%
自基金合同生效起至今	73.61%	1.98%	83.75%	2.02%	-10.14%	-0.04%

### 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

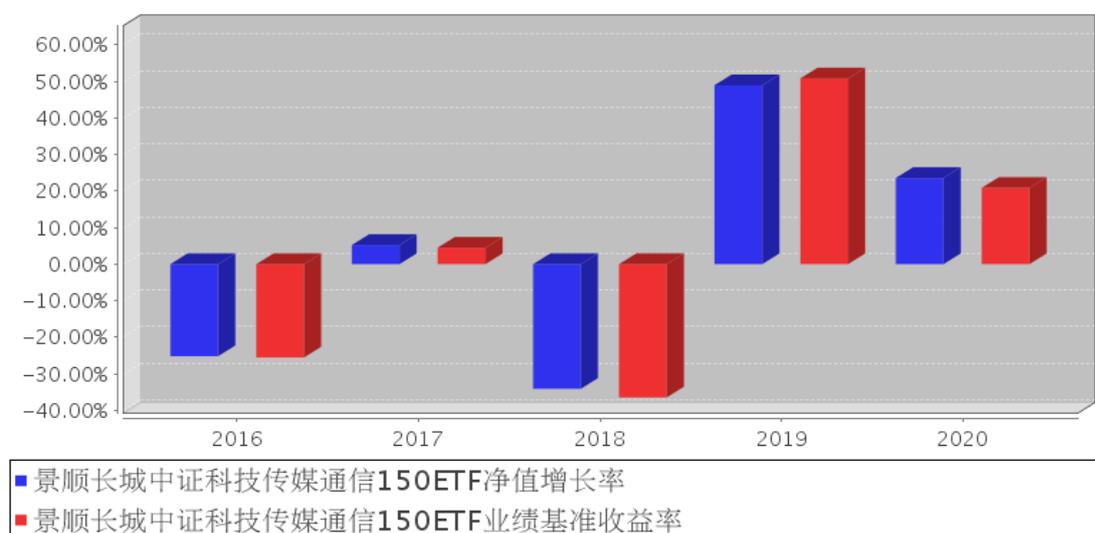
景顺长城中证科技传媒通信150ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的建仓期为自 2014 年 7 月 18 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。2020 年 12 月 15 日起，“景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金”的基金名称变更为“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”。

### 3.2.3 过去五年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

景顺长城中证科技传媒通信150ETF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



### 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		
曾理	本基金的基金经理	2019 年 11 月 19 日	2020 年 12 月 15 日	6 年	工学硕士。曾任职于腾讯计算机系统有限公司信息安全部产品策略岗位。2014 年 8 月加入本公司，历任量化及 ETF 投资部量化程序员、量化及指数投资部基金经理助理，自 2018 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理。
崔俊杰	本基金的基金经理、ETF 投资部投资总监	2020 年 7 月 25 日	-	12 年	管理学硕士。曾先后担任鹏华基金管理有限公司产品规划部产品设计师、量化投资部量化研究员、量化及衍生品投资部总经理助理兼基金经理、副总经理兼基金经理；自 2019 年 12 月加入本公司，自 2020 年 7 月起担任 ETF 投资部基金经理，现任 ETF 投资部投资总监兼基金经理。

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、《景顺长城中证科技传媒通信 150 交易型开放式指数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

所有投资对象的投资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，风险管理及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

2020 年 12 月工业增加值当月同比 7.30%，前值 7.00%，后疫情时代复苏态势愈加明显。12 月 PMI 指数为 51.90，维持在 50 以上，延续三季度以来的良好表现。12 月 PPI 同比-0.40%，环比 1.10%，自 5 月以来逐月上升；12 月 CPI 同比上涨 0.20%，前值-0.50%，环比 0.70%，基本保持稳定。12 月 M2 同比增速 10.10%，M1 同比增速 8.60%，社会融资规模存量同比增长 13.30%，增速继续抬升。12 月末外汇储备 3.22 万亿美元。由于海外疫情持续爆发，外需仍然旺盛，四季度延续三季度的高复苏态势，但环比修复的幅度逐步进入长期趋势区间。2020 年全年各主要指数均获得了不错的收益，上证综指、深证成指、沪深 300、中证 500、创业板指和科创 50 的收益率分别为 13.87%、38.73%、27.21%、20.87%、64.96%和 39.30%，各行业龙头企业逐渐从疫情中恢复，且部

分外需旺盛的行业快速发展，令主要指数表现存在一定的分化。

#### 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 23.56%，业绩比较基准收益率为 20.86%。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控制在 0.2% 以内，跟踪误差（年化）控制在 2% 以内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，国内 COVID-19 疫情零星出现，在持续常态化防疫状态中偶有反弹，经济不确定性有所上升。全球其他地区疫情形势仍然严峻，英国、南非、巴西等地新发变异，对当前疫苗有效性提出了挑战。疫苗生产及分发存在相当大程度的混乱，除中国外其他主要经济体疫苗接种进度受到部分影响。在全球上下游产业链持续受到冲击的情况下，国内经济一枝独秀，外需持续旺盛，但全球经济复苏仍然存在较大不确定因素。

拜登政府上台后，中美关系走向仍然不甚确定。当前美国对外释放出一定积极信号，由于建制派的存在中美关系得到一定的缓和，但不大可能得到根本性改善。未来预计中美之间将继续在竞争中求同存异，贸易争端等将持续存在且可能严重程度来回反复。

在当前时点来看，国内疫情后经济进入复苏进程，且经济增速已基本恢复至疫情前水平，国内经济增长的韧性在高频数据中得到了验证。在构建内外“双循环”过程中，预计未来整体经济复苏态势将延续，疫情及海外复杂的政治经济局势会对我国经济增长态势和技术发展突破造成短期影响，而中国经济发展的长期趋势仍将保持不变。

本基金采用完全复制中证科技传媒通信 150 指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。在报告期内，本基金结合申购赎回情况，根据指数成份股及其权重变化定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

#### 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、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。

截至本报告期末，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，本基金未满足收益分配条件，不进行利润分配。

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

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在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（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购

赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §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	普华永道中天审字(2021)第 21301 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	景顺长城中证科技传媒通信 150 交易型开放式指数证券投资基金(原景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金)全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了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(原景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金，以下简称“景顺长城中证科技传媒通信 150ETF”)的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了景顺长城中证科技传媒通信 150ETF 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城中证科技传媒通信 150ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	景顺长城中证科技传媒通信 150ETF 的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按

	<p>照企业会计准则和中国证监会、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，基金管理人管理层负责评估景顺长城中证科技传媒通信 150ETF 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，除非基金管理人管理层计划清算景顺长城中证科技传媒通信 150ETF、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督景顺长城中证科技传媒通信 150ETF 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</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>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人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>(四) 对基金管理人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，就可能对景顺长城中证科技传媒通信 150ETF 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中证科技传媒通信 150ETF 不能持续经营。</p> <p>(五) 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>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师的姓名	单峰	陈薇瑶
会计师事务所的地址	中国上海市	
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：景顺长城中证科技传媒通信 150 交易型开放式指数证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	9,826,483.24	8,141,946.68
结算备付金		189,280.56	2,248.59
存出保证金		97,249.40	7,849.59
交易性金融资产	7.4.7.2	452,362,714.03	310,603,102.09
其中：股票投资		452,213,314.03	310,603,102.09
基金投资		-	-
债券投资		149,400.00	-
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	-	-
应收证券清算款		1,870,772.67	56,674.24
应收利息	7.4.7.5	23,992.71	2,081.27
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		464,370,492.61	318,813,902.46
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,538,028.31	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		198,904.70	134,709.32
应付托管费		39,780.93	26,941.87

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	167,835.88	82,941.96
应交税费		2,128.57	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,542,819.57	364,005.15
负债合计		3,489,497.96	608,598.30
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	265,467,642.00	226,467,642.00
未分配利润	7.4.7.10	195,413,352.65	91,737,662.16
所有者权益合计		460,880,994.65	318,205,304.16
负债和所有者权益总计		464,370,492.61	318,813,902.46

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.7361 元，基金份额总额 265,467,642.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：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

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		105,016,327.35	117,815,512.68
1. 利息收入		312,662.99	50,907.25
其中：存款利息收入	7.4.7.11	63,532.99	50,880.86
债券利息收入		36.72	26.39
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		249,093.28	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		65,042,607.77	-30,661,401.33
其中：股票投资收益	7.4.7.12	61,426,449.06	-33,125,980.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	58,735.75	14,505.68
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	3,557,422.96	2,450,073.90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	38,640,570.87	148,309,515.62
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	1,020,485.72	116,491.14
减：二、费用		4,805,423.99	2,572,773.61
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,475,013.34	1,574,202.33
2. 托管费	7.4.10.2.2	495,002.57	314,840.55
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,492,649.92	336,256.48
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		897.12	0.06
7. 其他费用	7.4.7.19	341,861.04	347,474.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		100,210,903.36	115,242,739.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		100,210,903.36	115,242,739.07

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

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)	226,467,642.00	91,737,662.16	318,205,304.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	100,210,903.36	100,210,903.36
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）	39,000,000.00	3,464,787.13	42,464,787.13
其中：1. 基金申购款	273,000,000.00	171,176,098.36	444,176,098.36
2. 基金赎回款	-234,000,000.00	-167,711,311.23	-401,711,311.23
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)	265,467,642.00	195,413,352.65	460,880,994.65

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)	253,467,642.00	-14,372,145.52	239,095,496.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	115,242,739.07	115,242,739.07
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)	-27,000,000.00	-9,132,931.39	-36,132,931.39
其中：1. 基金申购款	31,500,000.00	8,109,804.73	39,609,804.73
2. 基金赎回款	-58,500,000.00	-17,242,736.12	-75,742,736.12
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)	226,467,642.00	91,737,662.16	318,205,304.16

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

景顺长城中证科技传媒通信 150 交易型开放式指数证券投资基金(原景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金,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[2014]546 号《关于核准景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数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《景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 593,963,628.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 416 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2014 年 7 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 593,967,642.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 4,014.00 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证函[2014]113 号文审核同意,本基金 593,967,642.00 份基金份额于 2014 年 8 月 19 日在上交所挂牌交易。

根据本基金的基金管理人景顺长城基金管理股份有限公司于 2020 年 12 月 10 日发布的《关于景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金变更基金名称及标的指数名称并修改基金合同与托管协议的公告》，中证指数有限公司于 2020 年 12 月 14 日将“中证 TMT150 指数”更名为“中证科技传媒通信 150 指数”，经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，自 2020 年 12 月 15 日起，本基金的基金名称变更为“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”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证科技传媒通信 150 指数(原“中证 TMT150 指数”)，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化；主要投资范围为中证科技传媒通信 150 指数(原“中证 TMT150 指数”)的成份股及备选成份股，该部分资产比例不低于基金资产净值的 90% 且不低于非现金基金资产的 80%。本基金可少量投资于部分非成份股(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)、衍生工具(股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产以及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)。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为：中证科技传媒通信 150 指数(原“中证 TMT150 指数”)。

本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了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(原景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，以下简称“景顺长城中证科技传媒通信 150ETF 联接基金”)。景顺长城中证科技传媒通信 150ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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 2021 年 3 月 24 日批准报出。

#### 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》、《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基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 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

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他金融负债包括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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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；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，单独确认为应收项目。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。

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。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券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的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 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；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 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认列。

#### 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认列，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。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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。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。

#### 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。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金的基金管理人可进行收益分配；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。本基金收益每年最多分配 12 次，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

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 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组

成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在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) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(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。

## 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	9,826,483.24	8,141,946.68
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	9,826,483.24	8,141,946.68

### 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	407,844,633.07	452,213,314.03	44,368,680.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	149,400.00	149,400.00
	银行间市场	-	-
	合计	149,400.00	149,400.00

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	407,994,033.07	452,362,714.03	44,368,680.96
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	304,874,992.00	310,603,102.09	5,728,110.09
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	304,874,992.00	310,603,102.09	5,728,110.09

注：于2020年12月31日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值0.00元(2019年12月31日：0.00元)。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从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	917.84	2,076.67
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	85.10	1.00
应收债券利息	4.55	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	22,941.42	-

其他	43.80	3.60
合计	23,992.71	2,081.27

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 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	167,835.88	82,941.96
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	167,835.88	82,941.96

#### 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	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	305,000.00	190,000.00
应付指数使用费	80,920.40	24,434.88
应退替代款	1,156,899.17	149,570.27
合计	1,542,819.57	364,005.15

#### 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	226,467,642.00	226,467,642.00
本期申购	273,000,000.00	273,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-234,000,000.00	-234,000,000.00
- 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	265,467,642.00	265,467,642.00

#### 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	-43,300,237.07	135,037,899.23	91,737,662.16
本期利润	61,570,332.49	38,640,570.87	100,210,903.36
本期基金份额交易产生的变动数	-19,092,905.15	22,557,692.28	3,464,787.13
其中：基金申购款	-45,352,200.52	216,528,298.88	171,176,098.36

基金赎回款	26,259,295.37	-193,970,606.60	-167,711,311.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-822,809.73	196,236,162.38	195,413,352.65

#### 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	53,026.26	49,389.67
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	8,368.91	1,336.95
其他	2,137.82	154.24
合计	63,532.99	50,880.86

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

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
股票投资收益——买卖股票差价收入	57,731,167.17	-28,515,982.55
股票投资收益——赎回差价收入	3,695,281.89	-4,609,998.36
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	61,426,449.06	-33,125,980.91

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

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
卖出股票成交总额	479,401,547.05	121,710,251.51
减：卖出股票成本总额	421,670,379.88	150,226,234.06
买卖股票差价收入	57,731,167.17	-28,515,982.55

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

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
赎回基金份额对价总额	401,711,311.23	75,742,736.12
减：现金支付赎回款总额	300,958,261.23	55,421,683.12
减：赎回股票成本总额	97,057,768.11	24,931,051.36
赎回差价收入	3,695,281.89	-4,609,998.36

## 7.4.7.12.4 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-证券出借差价收入。

## 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	331,868.89	123,532.65
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	273,100.00	109,000.00
减：应收利息总额	33.14	26.97
买卖债券差价收入	58,735.75	14,505.68

## 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

## 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	3,557,422.96	2,450,073.90
其中：证券出借权益补偿收入	11,893.18	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,557,422.96	2,450,073.90

## 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	38,640,570.87	148,309,515.62
股票投资	38,640,570.87	148,309,515.62
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	38,640,570.87	148,309,515.62

注：本基金本会计期间公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益 0.00 元。（上年度可比期间：0.00 元）

#### 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	-	-
替代损益	1,020,485.72	116,491.14
合计	1,020,485.72	116,491.14

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 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	1,492,649.92	336,256.48
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,492,649.92	336,256.48

#### 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	65,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	8,360.23	3,022.04
指数使用费	148,500.81	94,452.15
上市年费	-	60,000.00
合计	341,861.04	347,474.19

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。

于 2019 年度，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 1 万元。根据基金管理人于 2020 年 1 月 15 日发布的《关于调整景顺长城中证 TMT 150 交易型开放式指数证券投资

基金指数许可使用费收费方案的公告》，自 2020 年一季度起，本基金当季日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限调整为每季度人民币 1 万元，当季日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费无收取下限。

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
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
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司
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(“景顺长城中证科技传媒通信 150ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	740,403,568.13	76.42	112,766,646.89	53.61

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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	689,540.03	76.42	103,869.41	61.89
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	105,020.86	53.61	39,229.82	47.30

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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	2,475,013.34	1,574,202.33
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.50% 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 × 0.50% / 当年天数。

##### 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	495,002.57	314,840.55

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期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。

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证

券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019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 (%)
景顺长城中证科技传媒通信150ETF联接基金	228,790,600.00	86.18	220,592,100.00	97.41

##### 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
中国银行-活期	9,826,483.24	53,026.26	8,141,946.68	49,389.67

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

##### 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未在承销期内参与关联方承销的证券。

##### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 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
688390	固德威	2020年8月27日	2021年3月4日	新股流通受限	37.93	221.72	2,585	98,049.05	573,146.20	-
688788	科思科技	2020年10月13日	2021年4月22日	新股流通受限	106.04	109.59	3,120	330,844.80	341,920.80	-
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	3,120	80,184.00	275,464.80	-
300883	龙利得	2020年9月3日	2021年3月16日	新股流通受限	4.64	14.05	8,911	41,347.04	125,199.55	-
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	199	23,535.73	120,068.64	-
688379	华光新材	2020年8月11日	2021年2月19日	新股流通受限	16.78	23.63	4,950	83,061.00	116,968.50	-
688577	浙海德曼	2020年9月8日	2021年3月16日	新股流通受限	33.13	42.01	1,503	49,794.39	63,141.03	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	466	20,392.16	23,812.60	-
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	165	22,773.30	20,900.55	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
300895	铜牛信息	2020年9月17日	2021年3月24日	新股流通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
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	-
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	-
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	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别: 债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113616	韦尔转债	2020年12月29日	2021年1月22日	新债流通受限	100.00	100.00	1,350	135,000.00	135,000.00	-
123083	朗新转债	2020年12月9日	2021年1月6日	配债流通受限	100.00	100.00	144	14,400.00	14,400.00	-

注: 1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主

承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

#### 7.4.12.2 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。

#### 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。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	002475	立讯精密	2021年1月13日	56.12	55,400	3,109,048.00
2	002475	立讯精密	2021年1月6日	56.12	50,300	2,822,836.00
3	002415	海康威视	2021年1月13日	48.51	52,500	2,546,775.00
4	002415	海康威视	2021年1月6日	48.51	47,600	2,309,076.00
5	000725	京东方 A	2021年1月13日	6.00	380,900	2,285,400.00
6	000725	京东方 A	2021年1月6日	6.00	345,500	2,073,000.00
7	002027	分众传媒	2021年1月13日	9.87	144,400	1,425,228.00
8	000100	TCL 科技	2021年1月13日	7.08	197,300	1,396,884.00
9	002027	分众传媒	2021年1月6日	9.87	131,000	1,292,970.00
10	000063	中兴通讯	2021年1月13日	33.65	37,900	1,275,335.00
11	000100	TCL 科技	2021年1月6日	7.08	178,900	1,266,612.00
12	600570	恒生电子	2021年1月13日	104.90	11,500	1,206,350.00
13	002241	歌尔股份	2021年1月13日	37.32	31,900	1,190,508.00
14	000063	中兴通讯	2021年1月6日	33.65	34,400	1,157,560.00
15	600570	恒生电子	2021年1月6日	104.90	10,600	1,111,940.00
16	002241	歌尔股份	2021年1月6日	37.32	28,900	1,078,548.00
17	002410	广联达	2021年1月13日	78.74	13,300	1,047,242.00
18	002230	科大讯飞	2021年1月13日	40.87	24,700	1,009,489.00
19	600588	用友网络	2021年1月13日	43.87	23,000	1,009,010.00
20	002410	广联达	2021年1月6日	78.74	12,000	944,880.00
21	002230	科大讯飞	2021年1月6日	40.87	22,400	915,488.00
22	600588	用友网络	2021年1月6日	43.87	20,800	912,496.00
23	600703	三安光电	2021年1月13日	27.01	31,500	850,815.00
24	600703	三安光电	2021年1月6日	27.01	28,500	769,785.00
25	300413	芒果超媒	2021年1月13日	72.50	10,000	725,000.00
26	300454	深信服	2021年1月13日	248.01	2,800	694,428.00
27	300782	卓胜微	2021年1月13日	570.54	1,200	684,648.00

28	600584	长电科技	2021年1月13日	42.57	15,700	668,349.00
29	300413	芒果超媒	2021年1月6日	72.50	9,000	652,500.00
30	300454	深信服	2021年1月6日	248.01	2,600	644,826.00
31	300782	卓胜微	2021年1月6日	570.54	1,100	627,594.00
32	600584	长电科技	2021年1月6日	42.57	14,300	608,751.00
33	600050	中国联通	2021年1月13日	4.46	130,800	583,368.00
34	300408	三环集团	2021年1月13日	37.25	15,300	569,925.00
35	300433	蓝思科技	2021年1月13日	30.61	18,500	566,285.00
36	002555	三七互娱	2021年1月13日	31.23	17,800	555,894.00
37	600050	中国联通	2021年1月6日	4.46	118,600	528,956.00
38	300408	三环集团	2021年1月6日	37.25	13,900	517,775.00
39	688008	澜起科技	2021年1月13日	82.88	6,200	513,856.00
40	002008	大族激光	2021年1月13日	42.75	12,000	513,000.00
41	300433	蓝思科技	2021年1月6日	30.61	16,700	511,187.00
42	002555	三七互娱	2021年1月6日	31.23	16,100	502,803.00
43	002236	大华股份	2021年1月13日	19.89	25,200	501,228.00
44	603019	中科曙光	2021年1月13日	34.23	14,200	486,066.00
45	002624	完美世界	2021年1月13日	29.50	16,300	480,850.00
46	300496	中科创达	2021年1月13日	117.00	4,100	479,700.00
47	002600	领益智造	2021年1月13日	11.99	39,600	474,804.00
48	688008	澜起科技	2021年1月6日	82.88	5,700	472,416.00
49	000066	中国长城	2021年1月13日	18.99	24,700	469,053.00
50	002008	大族激光	2021年1月6日	42.75	10,900	465,975.00
51	688012	中微公司	2021年1月13日	157.59	2,900	457,011.00
52	002236	大华股份	2021年1月6日	19.89	22,900	455,481.00
53	600183	生益科技	2021年1月13日	28.16	16,100	453,376.00
54	601360	三六零	2021年1月13日	15.71	28,300	444,593.00
55	603019	中科曙光	2021年1月6日	34.23	12,900	441,567.00
56	002384	东山精密	2021年1月13日	26.00	16,800	436,800.00
57	002624	完美世界	2021年1月6日	29.50	14,800	436,600.00
58	300496	中科创达	2021年1月6日	117.00	3,700	432,900.00
59	002600	领益智造	2021年1月6日	11.99	35,900	430,441.00
60	688012	中微公司	2021年1月6日	157.59	2,700	425,493.00
61	000066	中国长城	2021年1月6日	18.99	22,400	425,376.00
62	002185	华天科技	2021年1月13日	13.62	30,800	419,496.00
63	600183	生益科技	2021年1月6日	28.16	14,600	411,136.00
64	000938	紫光股份	2021年1月13日	20.45	20,100	411,045.00
65	601360	三六零	2021年1月6日	15.71	25,800	405,318.00
66	002456	欧菲光	2021年1月13日	13.18	30,300	399,354.00
67	002384	东山精密	2021年1月6日	26.00	15,200	395,200.00
68	002405	四维图新	2021年1月13日	14.27	27,500	392,425.00
69	300136	信维通信	2021年1月13日	35.88	10,800	387,504.00
70	000977	浪潮信息	2021年1月13日	26.88	14,300	384,384.00

71	601138	工业富联	2021年1月13日	13.69	27,900	381,951.00
72	002185	华天科技	2021年1月6日	13.62	27,900	379,998.00
73	600522	中天科技	2021年1月13日	10.84	34,400	372,896.00
74	000938	紫光股份	2021年1月6日	20.45	18,200	372,190.00
75	002602	世纪华通	2021年1月13日	7.11	52,300	371,853.00
76	002456	欧菲光	2021年1月6日	13.18	27,400	361,132.00
77	002405	四维图新	2021年1月6日	14.27	25,000	356,750.00
78	300136	信维通信	2021年1月6日	35.88	9,800	351,624.00
79	300308	中际旭创	2021年1月13日	50.86	6,900	350,934.00
80	000977	浪潮信息	2021年1月6日	26.88	13,000	349,440.00
81	601138	工业富联	2021年1月6日	13.69	25,300	346,357.00
82	300661	圣邦股份	2021年1月13日	263.80	1,300	342,940.00
83	600522	中天科技	2021年1月6日	10.84	31,200	338,208.00
84	002602	世纪华通	2021年1月6日	7.11	47,500	337,725.00
85	688036	传音控股	2021年1月13日	152.14	2,200	334,708.00
86	688002	睿创微纳	2021年1月13日	111.00	3,000	333,000.00
87	300308	中际旭创	2021年1月6日	50.86	6,300	320,418.00
88	002463	沪电股份	2021年1月13日	18.79	16,900	317,551.00
89	688002	睿创微纳	2021年1月6日	111.00	2,800	310,800.00
90	300088	长信科技	2021年1月13日	8.89	34,400	305,816.00
91	688036	传音控股	2021年1月6日	152.14	2,000	304,280.00
92	002439	启明星辰	2021年1月13日	29.21	10,400	303,784.00
93	300661	圣邦股份	2021年1月6日	263.80	1,100	290,180.00
94	002131	利欧股份	2021年1月13日	3.03	94,900	287,547.00
95	002463	沪电股份	2021年1月6日	18.79	15,300	287,487.00
96	002465	海格通信	2021年1月13日	10.83	25,900	280,497.00
97	300628	亿联网络	2021年1月13日	73.12	3,800	277,856.00
98	300088	长信科技	2021年1月6日	8.89	31,200	277,368.00
99	600460	士兰微	2021年1月13日	25.00	11,000	275,000.00
100	600487	亨通光电	2021年1月13日	13.99	19,200	268,608.00
101	000988	华工科技	2021年1月13日	23.19	11,300	262,047.00
102	002131	利欧股份	2021年1月6日	3.03	86,100	260,883.00
103	300383	光环新网	2021年1月13日	17.17	15,100	259,267.00
104	600637	东方明珠	2021年1月13日	8.94	28,800	257,472.00
105	002465	海格通信	2021年1月6日	10.83	23,500	254,505.00
106	300168	万达信息	2021年1月13日	21.69	11,600	251,604.00
107	600460	士兰微	2021年1月6日	25.00	10,000	250,000.00
108	300628	亿联网络	2021年1月6日	73.12	3,400	248,608.00
109	600487	亨通光电	2021年1月6日	13.99	17,400	243,426.00
110	300223	北京君正	2021年1月13日	91.49	2,600	237,874.00
111	000988	华工科技	2021年1月6日	23.19	10,200	236,538.00
112	000021	深科技	2021年1月13日	19.01	12,400	235,724.00
113	300383	光环新网	2021年1月6日	17.17	13,700	235,229.00

114	600637	东方明珠	2021年1月6日	8.94	26,100	233,334.00
115	300168	万达信息	2021年1月6日	21.69	10,600	229,914.00
116	300418	昆仑万维	2021年1月13日	19.95	11,500	229,425.00
117	002739	万达电影	2021年1月13日	18.08	12,500	226,000.00
118	688099	晶晨股份	2021年1月13日	78.73	2,800	220,444.00
119	300223	北京君正	2021年1月6日	91.49	2,400	219,576.00
120	002065	东华软件	2021年1月13日	8.30	26,200	217,460.00
121	300271	华宇软件	2021年1月13日	23.87	9,100	217,217.00
122	000021	深科技	2021年1月6日	19.01	11,200	212,912.00
123	002373	千方科技	2021年1月13日	19.12	11,100	212,232.00
124	688009	中国通号	2021年1月13日	5.86	35,700	209,202.00
125	300418	昆仑万维	2021年1月6日	19.95	10,400	207,480.00
126	300115	长盈精密	2021年1月13日	24.65	8,400	207,060.00
127	600100	同方股份	2021年1月13日	6.20	33,300	206,460.00
128	688099	晶晨股份	2021年1月6日	78.73	2,600	204,698.00
129	002739	万达电影	2021年1月6日	18.08	11,300	204,304.00
130	000050	深天马A	2021年1月13日	14.74	13,800	203,412.00
131	300502	新易盛	2021年1月13日	55.48	3,600	199,728.00
132	300251	光线传媒	2021年1月13日	12.07	16,500	199,155.00
133	002273	水晶光电	2021年1月13日	11.59	17,100	198,189.00
134	300271	华宇软件	2021年1月6日	23.87	8,300	198,121.00
135	300315	掌趣科技	2021年1月13日	5.11	38,700	197,757.00
136	002065	东华软件	2021年1月6日	8.30	23,800	197,540.00
137	002558	巨人网络	2021年1月13日	17.43	11,300	196,959.00
138	600271	航天信息	2021年1月13日	12.60	15,600	196,560.00
139	688088	虹软科技	2021年1月13日	69.92	2,800	195,776.00
140	600667	太极实业	2021年1月13日	9.45	20,700	195,615.00
141	688009	中国通号	2021年1月6日	5.86	33,000	193,380.00
142	002373	千方科技	2021年1月6日	19.12	10,000	191,200.00
143	300017	网宿科技	2021年1月13日	6.89	27,500	189,475.00
144	300115	长盈精密	2021年1月6日	24.65	7,600	187,340.00
145	600100	同方股份	2021年1月6日	6.20	30,200	187,240.00
146	000050	深天马A	2021年1月6日	14.74	12,500	184,250.00
147	300502	新易盛	2021年1月6日	55.48	3,300	183,084.00
148	002195	二三四五	2021年1月13日	2.26	80,500	181,930.00
149	688088	虹软科技	2021年1月6日	69.92	2,600	181,792.00
150	002152	广电运通	2021年1月13日	10.68	16,900	180,492.00
151	300251	光线传媒	2021年1月6日	12.07	14,900	179,843.00
152	002273	水晶光电	2021年1月6日	11.59	15,500	179,645.00
153	002558	巨人网络	2021年1月6日	17.43	10,300	179,529.00
154	300315	掌趣科技	2021年1月6日	5.11	35,100	179,361.00
155	600271	航天信息	2021年1月6日	12.60	14,200	178,920.00
156	600667	太极实业	2021年1月6日	9.45	18,800	177,660.00

157	300747	锐科激光	2021年1月13日	87.86	2,000	175,720.00
158	300017	网宿科技	2021年1月6日	6.89	25,000	172,250.00
159	300058	蓝色光标	2021年1月13日	6.00	28,000	168,000.00
160	300212	易华录	2021年1月13日	30.65	5,400	165,510.00
161	002195	二三四五	2021年1月6日	2.26	72,900	164,754.00
162	300773	拉卡拉	2021年1月13日	29.92	5,500	164,560.00
163	002152	广电运通	2021年1月6日	10.68	15,300	163,404.00
164	300476	胜宏科技	2021年1月13日	21.57	7,500	161,775.00
165	300296	利亚德	2021年1月13日	6.36	25,000	159,000.00
166	300747	锐科激光	2021年1月6日	87.86	1,800	158,148.00
167	002436	兴森科技	2021年1月13日	9.46	16,700	157,982.00
168	000413	东旭光电	2021年1月13日	2.56	61,600	157,696.00
169	002429	兆驰股份	2021年1月13日	6.20	25,400	157,480.00
170	000997	新大陆	2021年1月13日	15.28	10,300	157,384.00
171	300058	蓝色光标	2021年1月6日	6.00	25,400	152,400.00
172	002745	木林森	2021年1月13日	14.59	10,400	151,736.00
173	300212	易华录	2021年1月6日	30.65	4,900	150,185.00
174	300773	拉卡拉	2021年1月6日	29.92	5,000	149,600.00
175	600728	佳都科技	2021年1月13日	7.59	19,700	149,523.00
176	300476	胜宏科技	2021年1月6日	21.57	6,900	148,833.00
177	300188	美亚柏科	2021年1月13日	21.54	6,800	146,472.00
178	300296	利亚德	2021年1月6日	6.36	22,700	144,372.00
179	002436	兴森科技	2021年1月6日	9.46	15,200	143,792.00
180	002429	兆驰股份	2021年1月6日	6.20	23,100	143,220.00
181	000413	东旭光电	2021年1月6日	2.56	55,900	143,104.00
182	600728	佳都科技	2021年1月6日	7.59	17,900	135,861.00
183	002174	游族网络	2021年1月13日	13.16	10,200	134,232.00
184	300188	美亚柏科	2021年1月6日	21.54	6,100	131,394.00
185	002387	维信诺	2021年1月13日	11.40	11,500	131,100.00
186	600977	中国电影	2021年1月13日	12.46	10,500	130,830.00
187	300369	绿盟科技	2021年1月13日	15.28	7,800	119,184.00
188	002387	维信诺	2021年1月6日	11.40	10,400	118,560.00
189	300770	新媒股份	2021年1月13日	70.30	1,600	112,480.00
190	300369	绿盟科技	2021年1月6日	15.28	7,100	108,488.00
191	002217	合力泰	2021年1月13日	4.10	26,200	107,420.00
192	300770	新媒股份	2021年1月6日	70.30	1,400	98,420.00
193	002217	合力泰	2021年1月6日	4.10	23,800	97,580.00
194	601098	中南传媒	2021年1月13日	9.53	10,100	96,253.00
195	600959	江苏有线	2021年1月13日	3.31	28,100	93,011.00
196	600959	江苏有线	2021年1月6日	3.31	25,500	84,405.00
197	601928	凤凰传媒	2021年1月13日	6.33	10,700	67,731.00
198	300768	迪普科技	2021年1月13日	36.39	1,600	58,224.00
199	300768	迪普科技	2021年1月6日	36.39	1,500	54,585.00

合计					5,162,600	85,332,416.00
----	--	--	--	--	-----------	---------------

### 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，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金持有除国债、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资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.03%（上年末：无）。

### 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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，并按照合同约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	9,826,483.24	-	-	-	-	-	9,826,483.24
结算备付金	189,280.56	-	-	-	-	-	189,280.56
存出保证金	97,249.40	-	-	-	-	-	97,249.40
交易性金融资产	-	-	-	-	149,400.00	452,213,314.03	452,362,714.03
应收利息	-	-	-	-	-	23,992.71	23,992.71
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,870,772.67	1,870,772.67
资产总计	10,113,013.20	-	-	-	149,400.00	454,108,079.41	464,370,492.61
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	198,904.70	198,904.70
应付托管费	-	-	-	-	-	39,780.93	39,780.93
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,538,028.31	1,538,028.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	167,835.88	167,835.88
应交税费	-	-	-	-	-	2,128.57	2,128.57
其他负债	-	-	-	-	-	1,542,819.57	1,542,819.57
负债总计	-	-	-	-	-	3,489,497.96	3,489,497.96
利率敏感度缺口	10,113,013.20	-	-	-	149,400.00	-	-
上年度末	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

2019年12月31日							
资产							
银行存款	8,141,946.68	-	-	-	-	-	8,141,946.68
结算备付金	2,248.59	-	-	-	-	-	2,248.59
存出保证金	7,849.59	-	-	-	-	-	7,849.59
交易性金融资产	-	-	-	-	310,603,102.09	-	310,603,102.09
应收利息	-	-	-	-	2,081.27	-	2,081.27
应收证券清算款	-	-	-	-	56,674.24	-	56,674.24
资产总计	8,152,044.86	-	-	-	310,661,857.60	-	318,813,902.46
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	134,709.32	-	134,709.32
应付托管费	-	-	-	-	26,941.87	-	26,941.87
应付交易费用	-	-	-	-	82,941.96	-	82,941.96
其他负债	-	-	-	-	364,005.15	-	364,005.15
负债总计	-	-	-	-	608,598.30	-	608,598.30
利率敏感度缺口	8,152,044.86	-	-	-	-	-	-

#### 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 0.03%（上年末：0.00%），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	452,213,314.03	98.12	310,603,102.09	97.61

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	452,213,314.03	98.12	310,603,102.09	97.61

#### 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%	20,504,080.19	18,759,728.75
	沪深 300 指数下降 5%	-20,504,080.19	-18,759,728.75

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 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属于第一层次的余额为 450,182,759.40 元，属于第二层次的余额为 2,179,954.63 元，无属于第三层次的余额（2019 年 12 月 31 日：第一层次 310,596,524.05 元，第二层次 6,578.04 元，无第三层次）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及

限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 基金申购款

于 2020 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 444,176,098.36 元(2019 年度：39,609,804.73 元)，其中包括以股票支付的申购款 120,917,931.72 元和以现金支付的申购款 323,258,166.64 元(2019 年度：其中包括以股票支付的申购款 10,578,436.00 元和以现金支付的申购款 29,031,368.73 元)。

(3) 除公允价值和基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	452,213,314.03	97.38
	其中：股票	452,213,314.03	97.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	149,400.00	0.03
	其中：债券	149,400.00	0.03
	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	10,015,763.80	2.16
8	其他各项资产	1,992,014.78	0.43
9	合计	464,370,492.61	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	307,201,103.96	66.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	556,393.00	0.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	118,121,835.44	25.63
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	12,357,387.00	2.68
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	11,946,040.00	2.59
S	综合	-	-
	合计	450,182,759.40	97.68

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,848,932.58	0.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	19,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,778.54	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	62,972.16	0.01
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	20,900.55	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,030,554.63	0.44

### 8.2.3 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

#### 8.3.1 期末指数投资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	002475	立讯精密	430,101	24,137,268.12	5.24
2	002415	海康威视	407,400	19,762,974.00	4.29
3	000725	京东方A	2,953,566	17,721,396.00	3.85
4	002027	分众传媒	1,120,100	11,055,387.00	2.40
5	603501	韦尔股份	46,900	10,838,590.00	2.35
6	000100	TCL 科技	1,529,500	10,828,860.00	2.35
7	000063	中兴通讯	294,500	9,909,925.00	2.15
8	600570	恒生电子	91,188	9,565,621.20	2.08
9	002241	歌尔股份	247,800	9,247,896.00	2.01
10	002410	广联达	103,300	8,133,842.00	1.76
11	002230	科大讯飞	191,750	7,836,822.50	1.70
12	600588	用友网络	178,437	7,828,031.19	1.70
13	603986	兆易创新	36,060	7,121,850.00	1.55
14	600703	三安光电	244,202	6,595,896.02	1.43
15	002049	紫光国微	46,100	6,168,641.00	1.34
16	300413	芒果超媒	77,420	5,612,950.00	1.22
17	300454	深信服	22,404	5,556,416.04	1.21
18	300782	卓胜微	9,560	5,454,362.40	1.18
19	600745	闻泰科技	54,400	5,385,600.00	1.17
20	600584	长电科技	122,400	5,210,568.00	1.13
21	002371	北方华创	26,800	4,843,832.00	1.05
22	002179	中航光电	59,780	4,680,176.20	1.02
23	600050	中国联通	1,014,200	4,523,332.00	0.98
24	300408	三环集团	118,800	4,425,300.00	0.96
25	300433	蓝思科技	143,600	4,395,596.00	0.95
26	002555	三七互娱	138,290	4,318,796.70	0.94
27	002841	视源股份	36,467	4,194,799.01	0.91
28	688008	澜起科技	49,200	4,077,696.00	0.88
29	002008	大族激光	93,300	3,988,575.00	0.87
30	603160	汇顶科技	25,200	3,919,860.00	0.85
31	002236	大华股份	196,200	3,902,418.00	0.85

32	603019	中科曙光	110,912	3,796,517.76	0.82
33	688012	中微公司	24,000	3,782,160.00	0.82
34	300496	中科创达	32,300	3,779,100.00	0.82
35	002938	鹏鼎控股	75,800	3,764,986.00	0.82
36	002624	完美世界	127,150	3,750,925.00	0.81
37	002600	领益智造	306,902	3,679,754.98	0.80
38	000066	中国长城	191,625	3,638,958.75	0.79
39	600183	生益科技	124,900	3,517,184.00	0.76
40	601360	三六零	221,284	3,476,371.64	0.75
41	002384	东山精密	130,300	3,387,800.00	0.74
42	002185	华天科技	239,036	3,255,670.32	0.71
43	000938	紫光股份	155,996	3,190,118.20	0.69
44	002456	欧菲光	234,800	3,094,664.00	0.67
45	002405	四维图新	214,075	3,054,850.25	0.66
46	300136	信维通信	83,969	3,012,807.72	0.65
47	000977	浪潮信息	111,263	2,990,749.44	0.65
48	601138	工业富联	216,400	2,962,516.00	0.64
49	600522	中天科技	267,300	2,897,532.00	0.63
50	002602	世纪华通	406,240	2,888,366.40	0.63
51	300308	中际旭创	54,520	2,772,887.20	0.60
52	688002	睿创微纳	24,966	2,771,226.00	0.60
53	688036	传音控股	17,900	2,723,306.00	0.59
54	300661	圣邦股份	10,000	2,638,000.00	0.57
55	000636	风华高科	77,800	2,621,860.00	0.57
56	600536	中国软件	32,300	2,543,948.00	0.55
57	002463	沪电股份	131,300	2,467,127.00	0.54
58	002439	启明星辰	81,300	2,374,773.00	0.52
59	300088	长信科技	266,900	2,372,741.00	0.51
60	002916	深南电路	21,472	2,320,264.32	0.50
61	002131	利欧股份	736,237	2,230,798.11	0.48
62	002465	海格通信	201,000	2,176,830.00	0.47
63	300628	亿联网络	29,400	2,149,728.00	0.47
64	600460	士兰微	85,900	2,147,500.00	0.47
65	600487	亨通光电	148,901	2,083,124.99	0.45
66	603444	吉比特	4,800	2,044,800.00	0.44
67	000988	华工科技	87,700	2,033,763.00	0.44
68	300383	光环新网	117,600	2,019,192.00	0.44
69	600637	东方明珠	223,230	1,995,676.20	0.43
70	300168	万达信息	90,736	1,968,063.84	0.43
71	600845	宝信软件	27,930	1,926,611.40	0.42
72	300223	北京君正	20,600	1,884,694.00	0.41
73	002180	纳思达	70,300	1,879,119.00	0.41

74	600498	烽火通信	76,800	1,849,344.00	0.40
75	002156	通富微电	72,500	1,829,900.00	0.40
76	000021	深科技	96,000	1,824,960.00	0.40
77	688099	晶晨股份	23,073	1,816,537.29	0.39
78	300418	昆仑万维	89,601	1,787,539.95	0.39
79	002739	万达电影	97,000	1,753,760.00	0.38
80	002138	顺络电子	70,400	1,726,208.00	0.37
81	300271	华宇软件	71,100	1,697,157.00	0.37
82	002065	东华软件	203,800	1,691,540.00	0.37
83	002151	北斗星通	33,200	1,690,212.00	0.37
84	688009	中国通号	282,300	1,654,278.00	0.36
85	002373	千方科技	86,300	1,650,056.00	0.36
86	300115	长盈精密	65,300	1,609,645.00	0.35
87	600100	同方股份	258,800	1,604,560.00	0.35
88	688088	虹软科技	22,800	1,594,176.00	0.35
89	300502	新易盛	28,700	1,592,276.00	0.35
90	000050	深天马A	107,101	1,578,668.74	0.34
91	603236	移远通信	8,408	1,571,791.52	0.34
92	300251	光线传媒	128,200	1,547,374.00	0.34
93	002558	巨人网络	88,340	1,539,766.20	0.33
94	002273	水晶光电	132,700	1,537,993.00	0.33
95	300315	掌趣科技	300,500	1,535,555.00	0.33
96	600271	航天信息	121,700	1,533,420.00	0.33
97	600667	太极实业	161,100	1,522,395.00	0.33
98	300017	网宿科技	214,397	1,477,195.33	0.32
99	002195	二三四五	623,772	1,409,724.72	0.31
100	002152	广电运通	131,200	1,401,216.00	0.30
101	601231	环旭电子	72,400	1,400,216.00	0.30
102	300747	锐科激光	15,600	1,370,616.00	0.30
103	603005	晶方科技	21,100	1,357,996.00	0.29
104	002281	光迅科技	45,400	1,318,416.00	0.29
105	300212	易华录	42,528	1,303,483.20	0.28
106	300058	蓝色光标	217,000	1,302,000.00	0.28
107	002690	美亚光电	29,390	1,301,389.20	0.28
108	603290	斯达半导	5,400	1,300,860.00	0.28
109	300773	拉卡拉	43,400	1,298,528.00	0.28
110	300476	胜宏科技	59,600	1,285,572.00	0.28
111	300296	利亚德	194,350	1,236,066.00	0.27
112	002436	兴森科技	129,800	1,227,908.00	0.27
113	002429	兆驰股份	197,700	1,225,740.00	0.27
114	000997	新大陆	80,100	1,223,928.00	0.27
115	000413	东旭光电	477,700	1,222,912.00	0.27

116	002745	木林森	80,600	1,175,954.00	0.26
117	002396	星网锐捷	50,800	1,171,448.00	0.25
118	600728	佳都科技	153,420	1,164,457.80	0.25
119	002368	太极股份	44,058	1,150,354.38	0.25
120	300188	美亚柏科	52,700	1,135,158.00	0.25
121	603927	中科软	27,600	1,106,484.00	0.24
122	002153	石基信息	35,100	1,091,259.00	0.24
123	002268	卫士通	63,933	1,067,681.10	0.23
124	600446	金证股份	65,600	1,063,376.00	0.23
125	603712	七一二	25,500	1,062,075.00	0.23
126	002174	游族网络	79,800	1,050,168.00	0.23
127	002387	维信诺	89,500	1,020,300.00	0.22
128	603000	人民网	59,900	1,012,310.00	0.22
129	600977	中国电影	81,200	1,011,752.00	0.22
130	002925	盈趣科技	14,889	957,809.37	0.21
131	300369	绿盟科技	60,700	927,496.00	0.20
132	300770	新媒股份	12,420	873,126.00	0.19
133	688188	柏楚电子	3,300	869,946.00	0.19
134	601698	中国卫通	47,900	868,906.00	0.19
135	002217	合力泰	203,700	835,170.00	0.18
136	300456	赛微电子	34,900	831,318.00	0.18
137	603228	景旺电子	27,558	830,873.70	0.18
138	600373	中文传媒	74,100	747,669.00	0.16
139	601098	中南传媒	78,200	745,246.00	0.16
140	600959	江苏有线	217,900	721,249.00	0.16
141	300792	壹网壹创	6,500	717,665.00	0.16
142	600776	东方通信	52,000	616,200.00	0.13
143	002815	崇达技术	38,600	557,384.00	0.12
144	600131	国网信通	39,100	556,393.00	0.12
145	601928	凤凰传媒	83,300	527,289.00	0.11
146	600556	天下秀	39,700	502,205.00	0.11
147	300682	朗新科技	33,450	489,039.00	0.11
148	300768	迪普科技	12,900	469,431.00	0.10
149	603893	瑞芯微	5,100	368,985.00	0.08
150	688001	华兴源创	4,400	173,360.00	0.04

### 8.3.2 期末积极投资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	688390	固德威	2,585	573,146.20	0.12
2	688788	科思科技	3,120	341,920.80	0.07

3	300999	金龙鱼	3,120	275,464.80	0.06
4	300883	龙利得	8,911	125,199.55	0.03
5	300896	爱美客	199	120,068.64	0.03
6	688379	华光新材	4,950	116,968.50	0.03
7	688577	浙海德曼	1,503	63,141.03	0.01
8	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.01
9	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.01
10	300900	广联航空	879	29,147.64	0.01
11	300877	金春股份	569	28,933.65	0.01
12	300868	杰美特	593	25,665.04	0.01
13	300861	美畅股份	466	23,812.60	0.01
14	300860	锋尚文化	165	20,900.55	0.00
15	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
16	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
17	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
18	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
19	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
20	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
21	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
22	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
23	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
24	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
25	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
26	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
27	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
28	300886	华业香料	147	6,713.49	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	002475	立讯精密	23,687,836.88	7.44
2	002415	海康威视	18,251,461.27	5.74
3	000725	京东方 A	16,782,352.00	5.27
4	000063	中兴通讯	15,455,003.81	4.86
5	000100	TCL 科技	10,796,343.00	3.39
6	600570	恒生电子	9,799,462.08	3.08
7	002602	世纪华通	8,659,181.00	2.72
8	002230	科大讯飞	8,108,895.87	2.55
9	002241	歌尔股份	8,107,252.65	2.55
10	002027	分众传媒	7,997,150.00	2.51
11	002410	广联达	7,904,299.00	2.48

12	603501	韦尔股份	7,028,497.00	2.21
13	002555	三七互娱	7,003,368.92	2.20
14	002371	北方华创	6,432,854.00	2.02
15	000938	紫光股份	6,325,713.00	1.99
16	000977	浪潮信息	6,111,492.16	1.92
17	300413	芒果超媒	5,814,784.10	1.83
18	300661	圣邦股份	5,669,746.50	1.78
19	002008	大族激光	5,624,908.18	1.77
20	300136	信维通信	5,472,400.00	1.72

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	002475	立讯精密	30,402,483.22	9.55
2	002415	海康威视	19,896,298.70	6.25
3	000725	京东方 A	16,853,598.00	5.30
4	600570	恒生电子	14,739,004.60	4.63
5	000063	中兴通讯	13,394,860.90	4.21
6	000100	TCL 科技	11,941,276.52	3.75
7	002241	歌尔股份	10,347,954.87	3.25
8	002027	分众传媒	9,811,371.30	3.08
9	002230	科大讯飞	7,511,257.88	2.36
10	002410	广联达	7,288,406.09	2.29
11	002371	北方华创	6,703,684.00	2.11
12	300033	同花顺	6,433,570.00	2.02
13	002555	三七互娱	6,151,091.67	1.93
14	300136	信维通信	5,925,887.89	1.86
15	300413	芒果超媒	5,625,373.88	1.77
16	000977	浪潮信息	5,401,561.12	1.70
17	002049	紫光国微	5,350,858.00	1.68
18	002236	大华股份	5,249,746.42	1.65
19	000938	紫光股份	5,195,195.91	1.63
20	300433	蓝思科技	5,068,042.00	1.59

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	500,779,857.34
卖出股票收入（成交）总额	479,401,547.05

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	149,400.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	149,400.00	0.03

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113616	韦尔转债	1,350	135,000.00	0.03
2	123083	朗新转债	144	14,400.00	0.00

## 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，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 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

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。

### 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	97,249.40
2	应收证券清算款	1,870,772.67
3	应收股利	-
4	应收利息	23,992.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,992,014.78

### 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

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五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	占基金资产净	流通受限情况说明
----	------	------	----------	--------	----------

			允价值	值比例 (%)	
1	688390	固德威	573,146.20	0.12	新股流通受限
2	688788	科思科技	341,920.80	0.07	新股流通受限
3	300999	金龙鱼	275,464.80	0.06	新股流通受限
4	300883	龙利得	125,199.55	0.03	新股流通受限
5	300896	爱美客	120,068.64	0.03	新股流通受限

### 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

#### 9.1.1 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 (%)
782	339,472.69	28,012,375.00	10.56	8,664,667.00	3.26

#### 9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国银行股份有限公司一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	228,790,600.00	86.18

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份 额比例 (%)
1	中国银行股份有限公司一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	228,790,600.00	86.18
2	友邦保险有限公司江苏分公司一传统一普通保险产品	13,528,900.00	5.10
3	友邦保险有限公司上海分公司一传统一普通保险产品	5,485,900.00	2.07
4	方正证券股份有限公司	3,187,011.00	1.20
5	中信证券股份有限公司	3,158,064.00	1.19
6	招商证券股份有限公司	2,651,900.00	1.00
7	王强	490,000.00	0.18
8	杨方翠	430,000.00	0.16
9	周蓉	300,000.00	0.11

10	张沛	268,800.00	0.10
11	朱宗云	200,000.00	0.08

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

### 9.4 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。

### 9.5 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（2014年7月18日） 基金份额总额	593,967,642.00
本报告期期初基金份额总额	226,467,642.00
本报告期基金总申购份额	273,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	234,000,000.00
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	265,467,642.00

## §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

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 7 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 65,000.00 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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券股份有限公司	3	740,403,568.13	76.42%	689,540.03	76.42%	-
中信建投证券股份有限公司	2	228,455,501.35	23.58%	212,761.00	23.58%	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

## 1) 选择标准

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

专门研究报告。

## 2) 选择程序

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

### 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
长城证券股份有限公司	92,230.60	27.79%	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	239,638.29	72.21%	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中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	关于调整景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费收费方案的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-15
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下沪市跨市场 ETF 调整申赎结算模式的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-15
3	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-15

4	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-15
5	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-21
6	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
7	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
8	景顺长城基金管理有限公司关于可对旗下交易型开放式指数证券投资基金设置赎回上限的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-22
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-12
15	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
16	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
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
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-20
20	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-20
21	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-22
22	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
23	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
24	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
25	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

26	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
27	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-30
28	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 2 号更新招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-30
29	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
30	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
31	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
32	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-21
33	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
34	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-25
35	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 3 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-29
36	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 3 号更新招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-29
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	2020-07-31
38	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-24
39	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
40	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数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
41	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
42	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
43	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
44	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	2020-09-24
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	2020-09-26
46	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
47	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	2020-10-16

	告	定报刊及网站	
48	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
49	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-27
50	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
51	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
52	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金申购蚂蚁科技集团股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-04
53	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
54	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-04
55	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数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
56	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数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
57	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数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
58	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
59	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
60	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
61	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
62	关于景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金变更基金名称及标的指数名称并修改基金合同与托管协议的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-10
63	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 2020 年第 5 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-10
64	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基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-10
65	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基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-10
66	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托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-10
67	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金变更基金名称的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-15
68	景顺长城基金管理有限公司关于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基金经	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-16

	理变更公告		
69	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 2020 年第 6 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-18
70	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基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-18

## §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

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 (%)
本基金的联接基金	1	20200101-20201231	220,592,100.00	183,200,000.00	175,001,500.00	228,790,600.00	86.18

#### 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据中证指数有限公司下发的《关于国内市场 A 股 ETF 收费调整的通知》以及基金合同的有关规定，本公司决定自 2020 年第一季度起，对本基金的指数许可使用费收费方案进行调整，调整方案如下：本基金当季日均基金资产净值大于人民币 5000 万元时，指数许可使用费收取下限为每季度人民币 1 万元（大写：壹万元整）；本基金当季日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，指数许可使用费收取不设下限金额。有关详细信息参见本基金管理

人于 2020 年 1 月 15 日发布的《关于调整景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费收费方案的公告》。

2、根据《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则（2020 年修订）》和《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及相关规定，本公司决定于 2020 年 1 月 20 日起对本基金申购赎回的结算模式进行调整。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 1 月 15 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于旗下沪市跨市场 ETF 调整申赎结算模式的提示性公告》。

3、自 2020 年 2 月 3 日起，本基金可根据基金运作情况、市场变化、投资者需求等设置基金赎回上限，申购、赎回规则参照中国证券登记结算有限责任公司的规定，具体信息以基金管理人在证券交易所公告的申购赎回清单为准。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 1 月 22 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于可对旗下交易型开放式指数证券投资基金设置赎回上限的公告》。

4、本公司根据上海证券交易所于 2020 年 2 月 19 日发布的《关于上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称相关事项的通知》（上证函[2020]268 号）的相关要求及规范，为本基金在原有证券简称的基础上，向上海证券交易所申请增加扩位证券简称：TMT150ETF。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 3 月 12 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告》。

5、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》。

6、根据中证指数有限公司 2020 年 11 月 4 日发布的《关于修订中证全球中国互联网指数等 18 条指数编制方案的公告》，“中证 TMT150 指数”于 2020 年 12 月 14 日更名为“中证科技传媒通信 150 指数”，除指数名称外编制方案其余部分不变。景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的跟踪标的为“中证 TMT150 指数”。根据景顺长城中证

TMT150 交易型开放式指数证券投资基金基金合同和景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同的有关规定，经与两只基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2020 年 12 月 15 日起对两只基金变更基金名称、标的指数名称及业绩比较基准，并对两只基金的基金合同和托管协议作相应修改。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 12 月 10 日发布的《关于景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金变更基金名称及标的指数名称并修改基金合同与托管协议的公告》、2020 年 12 月 15 日发布的《景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金变更基金名称的提示性公告》。

## §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中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《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基金合同》；
- 3、《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招募说明书》；
- 4、《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