

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 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 23 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人及基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 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	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末上市基金前十名持有人	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.4 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	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城中证红利低波动 100ETF
场内简称	红利 100（扩位证券简称：低波红利 ETF）
基金主代码	515100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 22 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	70,941,529.00 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	2020 年 7 月 3 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，以期获得与标的指数收益相似的回报。
投资策略	本基金以中证红利低波动 100 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。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。 本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

业绩比较基准	中证红利低波动 100 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。

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	交通银行股份有限公司
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	95559
传真	0755-22381339	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518048	200336
法定代表人	李进	任德奇

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	12,478,764.03
本期利润	12,194,737.41
加权平均基金份额本期利润	0.1623
本期加权平均净值利润率	12.71%
本期基金份额净值增长率	13.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	25,756,288.73
期末可供分配基金份额利润	0.3631

期末基金资产净值	96,697,817.73
期末基金份额净值	1.3631
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	36.31%

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。

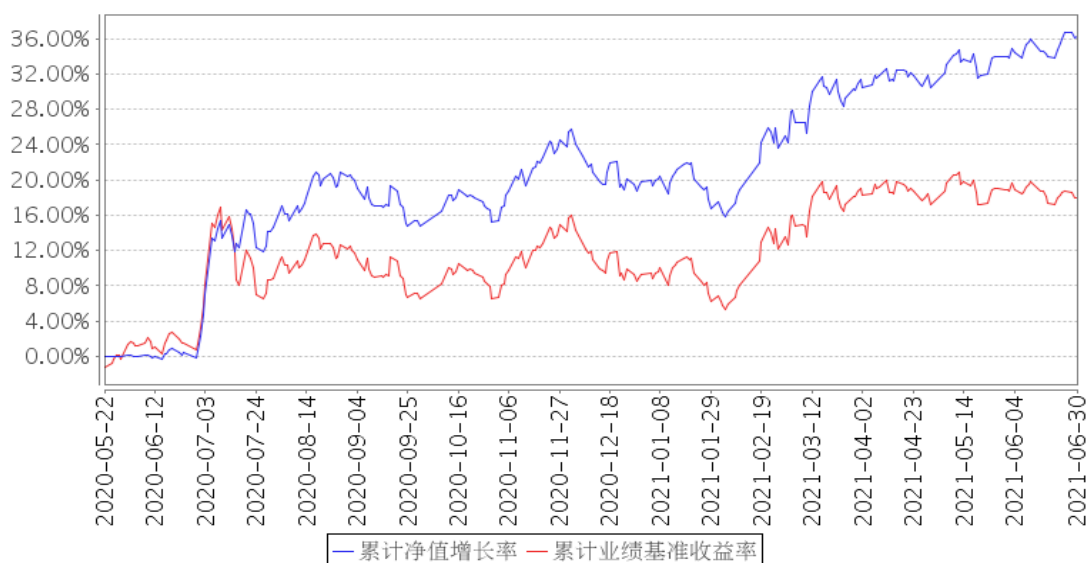
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	1.73%	0.45%	-0.77%	0.45%	2.50%	0.00%
过去三个月	4.07%	0.55%	-0.65%	0.58%	4.72%	-0.03%
过去六个月	13.79%	0.80%	7.97%	0.84%	5.82%	-0.04%
过去一年	35.56%	0.97%	16.41%	1.04%	19.15%	-0.07%
自基金合同生效起至今	36.31%	0.92%	18.01%	1.01%	18.30%	-0.09%

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

景顺长城中证红利低波动100ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的建仓期为自 2020 年 5 月 22 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。报告期末距离建仓结束期未满一年。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“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 2021 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 124 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、景顺长城中小创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、景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、景顺长城核心招景混合型证券投资基金、景顺长城景泰恒利一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城产业趋势混合型证券投资基金、景顺长城景泰益利纯债债券型证券投资基金、景顺长城成长龙头一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城品质长青混合型证券投资基金、景顺长城新能源产业股票型证券投资基金、景顺长城安泽回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城泰源回报混合型证券投资基金、景顺长城景骊成长混合型证券投资基金、景顺长城安盈回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城景气成长混合型证券投资基金、景顺长城安益回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城颐心养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。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		
张 晓 南	本基金的基金经理	2020 年 5 月 22 日	-	11 年	经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020 年 2 月加入本公司，自 2020 年 4 月起担任 ETF 投资部基金经理。具有 11 年证券、基金行业从业经验。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《景顺长城中证红利低波动 100 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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 7 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年 6 月工业增加值当月同比 8.30%，前值 8.80%，受去年 1 季度疫情影响低基数所致，且去年低基数影响逐渐减弱，预期将很快回到长期均值；当月环比 0.56%，与之前基本持平，后疫情时代复苏趋势延续。6 月 PMI 指数为 50.90，维持在 50 以上，略有回调。6 月 PPI 同比 8.80%，前值 9.00%，环比 0.30%，通胀预期有所回落；CPI 同比 1.10%，前值 1.30%，环比 -0.40%，基本保持稳定。6 月 M2 同比增速 8.60%，M1 同比增速 5.50%，社会融资规模存量同比增长 11.00%，增速逐渐降低至均衡水平。6 月末外汇储备 3.21 万亿美元。受到变异病毒影响，部分国家疫情出现反复，生产活动无法完全恢复，从而令国内二季度延续去年三季度开始的高复苏态势，当前工业生产基本恢复至疫情前水平。2021 年上半年市场各板块走势分化较大，创业板指和科创 50 表现出明显的成长性，代表传统经济的上证 50 表现较差；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 3.40%、4.78%、0.24%、6.93%、17.22% 和 14.01%，在去年四季度市场回暖后，一季度多数板块有所回调，二季度以芯片及新能源车为代表的科技板块显示出明显的盈利驱动复苏态势。

当前新冠疫情在国内已经得到控制，但全球抗疫形势仍不容乐观。随着病毒变种的逐渐出现，部分前期控制较好的国家疫情又出现了反复。当前英国已经处在第三波疫情爆发期；美国再次出现反弹；印度确诊病例虽较最高点回落，但仍居高不下；印尼成为亚洲除印度之外的又一病毒“培养皿”；日本急于举办奥运会，其国内管制放松令确诊数再次升高，奥运运动员的聚集可能导致新一轮世界疫情传播。

国内经济目前仍然能够享受到疫情红利，在全球主要经济体经济增长停滞甚至衰退的形势下，国内生产厂商在国内疫情结束较早、生产恢复较快的情形下，相当大一部分的填补了国内外需求缺口，且在国外尚未完全走出疫情影响前，这一趋势并不会发生转变。而在全球经济摆脱疫情影响后，国内生产厂商在全球供应链中的地位也会有所提高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年上半年，本基金份额净值增长率为 13.79%，业绩比较基准收益率为 7.97%。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

展望下半年，疫情仍然在全球蔓延，且由于大部分国家疫苗接种率无法快速提升，疫情拐点仍未可见。全球产能恢复的速度在当前时点无法明确预见，而“中国制造”为全球工业品和消费品的生产做出了卓越的贡献，也为国内经济增长提供了坚实的基础。同时，近期发布的《中共中央、国务院关于支持浦东新区高水平改革开放、打造社会主义现代化建设引领区的意见》提出在全证券市场稳步实施以信息披露为核心的注册制、在科创板引入做市商制度，逐步完善金融基础设置和制度。在整体经济复苏加快的基础上，资本市场仍有强大的吸引力，我们对市场保持乐观。当前继续看好成长板块在全球经济复苏阶段的表现，后续成长性高、现金流好、行业竞争格局稳定且公司地位明确的股票更有优势。

本基金采用完全复制中证红利低波动 100 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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，基金托管人在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的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，景顺长城基金管理有限公司在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投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由景顺长城基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关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的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			

银行存款	6.4.7.1	1,696,751.45	2,342,989.33
结算备付金		36,255.79	146,871.28
存出保证金		15,055.45	537,122.19
交易性金融资产	6.4.7.2	95,090,786.94	125,352,278.75
其中：股票投资		94,971,786.94	125,352,278.75
基金投资		-	-
债券投资		119,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		88,279.51	149,274.52
应收利息	6.4.7.5	434.65	809.40
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		96,927,563.79	128,529,345.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,879.05	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		37,154.31	55,670.04
应付托管费		7,430.86	11,134.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	63,979.28	125,946.39
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	119,302.56	236,462.10
负债合计		229,746.06	429,212.54
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	70,941,529.00	106,941,529.00
未分配利润	6.4.7.10	25,756,288.73	21,158,603.93
所有者权益合计		96,697,817.73	128,100,132.93
负债和所有者权益总计		96,927,563.79	128,529,345.47

注： 报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3631 元，基金份额总额 70,941,529.00

份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 22 日（基金合 同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		12,847,594.58	9,070,306.40
1. 利息收入		10,366.44	1,599,126.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	10,337.30	759,387.92
债券利息收入		29.14	-
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		-	839,738.29
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填 列）		13,098,865.58	10,406,265.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,543,360.76	9,121.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	760.41	-
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,554,744.41	10,397,143.72
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	-284,026.62	-2,935,085.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	6.4.7.17	22,389.18	-
减：二、费用		652,857.17	2,083,004.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	238,470.40	681,408.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	47,694.02	136,281.78
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	210,710.19	1,206,562.26
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支		-	-

出			
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6. 4. 7. 19	155, 982. 56	58, 751. 73
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		12, 194, 737. 41	6, 987, 301. 87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12, 194, 737. 41	6, 987, 301. 87

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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）	106, 941, 529. 00	21, 158, 603. 93	128, 100, 132. 93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12, 194, 737. 41	12, 194, 737. 41
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）	-36, 000, 000. 00	-7, 597, 052. 61	-43, 597, 052. 61
其中：1. 基金申购款	20, 000, 000. 00	6, 271, 018. 37	26, 271, 018. 37
2. 基金赎回款	-56, 000, 000. 00	-13, 868, 070. 98	-69, 868, 070. 98
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）	70, 941, 529. 00	25, 756, 288. 73	96, 697, 817. 73
项目	上年度可比期间 2020 年 5 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 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, 276, 941, 529. 00	-	1, 276, 941, 529. 00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6, 987, 301. 87	6, 987, 301. 87
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)			
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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, 276, 941, 529. 00	6, 987, 301. 87	1, 283, 928, 830. 87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城中证红利低波动 100 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[2019]379 号《关于准予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注册的批复》和机构部函[2019]2565 号《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延期募集备案的回函》核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证红利低波动 100 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指数基金，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 1, 276, 941, 529. 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(2020)第 0397 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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基金合同》于 2020 年 5 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1, 276, 941, 529. 00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]172 号文审核同意，本基金 1, 276, 941, 529. 00 份基金份额于 2020 年 7 月 3 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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红利低波动

100 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。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资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，为更好地实现投资目标，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）、股指期货、权证、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、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）。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。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%。本基金的业绩比较基准为中证红利低波动 100 指数收益率。

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 8 月 19 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市

公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。

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

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

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

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	1,696,751.45
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	1,696,751.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	95,555,191.50	94,971,786.94	-583,404.56
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	119,000.00	-
	银行间市场	-	-
	合计	119,000.00	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	95,674,191.50	95,090,786.94	-583,404.56

注：于 2021 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增 0.00 元。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	405.51
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	14.67
应收债券利息	8.35
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	-
其他	6.12
合计	434.65

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	63,979.28
银行间市场应付交易费用	-
合计	63,979.28

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 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	84,302.56
应付指数使用费	35,000.00
合计	119,302.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	106,941,529.00	106,941,529.00
本期申购	20,000,000.00	20,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-56,000,000.00	-56,000,000.00
- 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	70,941,529.00	70,941,529.00

6.4.7.10 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	37,889,832.73	-16,731,228.80	21,158,603.93
本期利润	12,478,764.03	-284,026.62	12,194,737.41
本期基金份额交易产生的变动数	-12,464,660.37	4,867,607.76	-7,597,052.61
其中：基金申购款	8,804,020.94	-2,533,002.57	6,271,018.37
基金赎回款	-21,268,681.31	7,400,610.33	-13,868,070.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,903,936.39	-12,147,647.66	25,756,288.73

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,702.73
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,013.07
其他	621.50
合计	10,337.30

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	10,720,215.32
股票投资收益——赎回差价收入	823,145.44
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	11,543,360.76

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	67,282,287.83
减：卖出股票成本总额	56,562,072.51
买卖股票差价收入	10,720,215.32

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	69,868,070.98
减：现金支付赎回款总额	11,941,654.98
减：赎回股票成本总额	57,103,270.56
赎回差价收入	823,145.44

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	186,781.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	186,000.00
减：应收利息总额	20.79
买卖债券差价收入	760.41

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,554,744.41
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	1,554,744.41

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-284,026.62
股票投资	-284,026.62
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	-284,026.62

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 50.00 元。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	22,389.18
合计	22,389.18

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	210,710.19
银行间市场交易费用	-
合计	210,710.19

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,680.00
指数使用费	70,000.00
合计	155,982.56

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% 的季费率计提，逐日累计，按季支付。

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为每季度人民币 3.5 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 22 日（基金合 同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
----	--	---

当期发生的基金应支付的管理费	238,470.40	681,408.76
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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	47,694.02	136,281.78

注：支付基金托管人交通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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

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

本基金本报告期未及上年度可比期间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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 5 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期	1,696,751.45	8,702.73	177,230,452.47	407,017.85

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有 464,200.00 股托管人交通银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 2,214,046.78 元，估值总额为人民币 2,274,580.00 元，占基金资产净值的比例为 2.35%（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有 554,100 股托管人交通银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 2,630,594.71 元，估值总额为人民币 2,482,368.00 元，占基金资产净值的比例为 1.94%）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股流通受限	21.96	21.96	987	21,674.52	21,674.52	-
688092	爱科科技	2021 年 3 月 12 日	2021 年 9 月 22 日	新股流通受限	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
688217	睿昂基因	2021 年 5 月 7 日	2021 年 11 月 17 日	新股流通受限	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	-

			日							
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688276	百克生物	2021 年 6 月 17 日	2021 年 12 月 27 日	新股流通受限	36.35	79.48	616	22,391.60	48,959.68	-
688314	康拓医疗	2021 年 5 月 11 日	2021 年 11 月 18 日	新股流通受限	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
688317	之江生物	2021 年 1 月 8 日	2021 年 7 月 19 日	新股流通受限	43.22	63.82	1,189	51,388.58	75,881.98	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股流通受限	38.85	38.85	728	28,282.80	28,282.80	-
688517	金冠电气	2021 年 6 月 10 日	2021 年 12 月 20 日	新股流通受限	7.71	11.88	2,840	21,896.40	33,739.20	-
688611	杭州柯林	2021 年 4 月 1 日	2021 年 10 月 12 日	新股流通受限	33.44	42.34	756	25,280.64	32,009.04	-
688616	西力科技	2021 年 3 月 10 日	2021 年 9 月 22 日	新股流通受限	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04	-
688669	聚石化学	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 26 日	新股流通受限	36.65	32.39	1,149	42,110.85	37,216.11	-
688680	海优新材	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	69.94	243.61	608	42,523.52	148,114.88	-

6.4.12.1.2 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
113050	南银转债	2021 年 6 月 16 日	2021 年 7 月 1 日	新债流通受限	100.00	100.00	1,190	119,000.00	119,000.00	-

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。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金

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

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

于本期末，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 0.12%（上年末：0.0%）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行

的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人通过定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	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
-----	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

2021年6月30日							
资产							
银行存款	1,696,751.45	-	-	-	-	-	1,696,751.45
结算备付金	36,255.79	-	-	-	-	-	36,255.79
存出保证金	15,055.45	-	-	-	-	-	15,055.45
交易性金融资产	-	-	-	-	119,000.00	94,971,786.94	95,090,786.94
应收利息	-	-	-	-	-	434.65	434.65
应收证券清算款	-	-	-	-	-	88,279.51	88,279.51
资产总计	1,748,062.69	-	-	-	119,000.00	95,060,501.10	96,927,563.79
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	37,154.31	37,154.31
应付托管费	-	-	-	-	-	7,430.86	7,430.86
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,879.05	1,879.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	63,979.28	63,979.28
其他负债	-	-	-	-	-	119,302.56	119,302.56
负债总计	-	-	-	-	-	229,746.06	229,746.06
利率敏感度缺口	1,748,062.69	-	-	-	119,000.00	-	-
上年度末 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	2,342,989.33	-	-	-	-	-	2,342,989.33
结算备付金	146,871.28	-	-	-	-	-	146,871.28
存出保证金	537,122.19	-	-	-	-	-	537,122.19
交易性金融资产	-	-	-	-	-	125,352,278.75	125,352,278.75
应收利息	-	-	-	-	-	809.40	809.40
应收证券清算款	-	-	-	-	-	149,274.52	149,274.52
资产总计	3,026,982.80	-	-	-	-	125,502,362.67	128,529,345.47
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	55,670.04	55,670.04
应付托管费	-	-	-	-	-	11,134.01	11,134.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	125,946.39	125,946.39
其他负债	-	-	-	-	-	236,462.10	236,462.10
负债总计	-	-	-	-	-	429,212.54	429,212.54
利率敏感度缺口	3,026,982.80	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 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 0.12%（上年末：0.0%），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）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	94,971,786.94	98.22	125,352,278.75	97.85
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	94,971,786.94	98.22	125,352,278.75	97.85

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
分析	沪深 300 指数上升 5%	992,617.94	3,833,840.69
	沪深 300 指数下降 5%	-992,617.94	-3,833,840.69

6.4.14 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 2021 年 6 月 30 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 94,284,308.62 元，属于第二层次的余额为 806,478.32 元，无属于第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：第一层次 123,095,054.85 元，第二层次 2,257,223.90 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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2020 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 2021 年上半年，本基金申购基金份额的对价总额为 26,271,018.37 元，其中包括以股票支

付的申购款 18,127,496.96 元和以现金支付的申购款 8,143,521.41 元。(于 2020 年上半年度,基金未上市,无申购数据)

(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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	94,971,786.94	97.98
	其中:股票	94,971,786.94	97.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	119,000.00	0.12
	其中:债券	119,000.00	0.12
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,733,007.24	1.79
8	其他各项资产	103,769.61	0.11
9	合计	96,927,563.79	100.00

注:本表权益投资股票项中,含可退替代款估值增值 0.00 元,而 7.2 中不含可退替代款估值增值,因此二者存在差异。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	929,739.00	0.96
B	采矿业	5,444,513.52	5.63
C	制造业	18,643,371.82	19.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,844,556.64	9.15
E	建筑业	7,539,665.00	7.80
F	批发和零售业	3,355,058.00	3.47
G	交通运输、仓储和邮政业	6,989,349.00	7.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	691,236.00	0.71
J	金融业	21,227,524.00	21.95
K	房地产业	15,596,154.96	16.13

L	租赁和商务服务业	750,480.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	635,824.00	0.66
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	3,571,664.76	3.69
S	综合	-	-
	合计	94,219,136.70	97.44

7.2.2 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	690,022.30	0.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.01
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	12,230.40	0.01
J	金融业	34,721.10	0.04
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	752,650.24	0.78

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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	601006	大秦铁路	446,700	2,939,286.00	3.04
2	000036	华联控股	588,760	2,743,621.60	2.84
3	603328	依顿电子	345,900	2,576,955.00	2.66
4	600028	中国石化	572,000	2,493,920.00	2.58
5	601328	交通银行	464,200	2,274,580.00	2.35
6	601988	中国银行	705,500	2,172,940.00	2.25
7	601169	北京银行	375,900	1,830,633.00	1.89
8	601288	农业银行	586,200	1,776,186.00	1.84
9	002110	三钢闽光	255,000	1,718,700.00	1.78
10	600377	宁沪高速	166,900	1,628,944.00	1.68
11	600376	首开股份	289,800	1,622,880.00	1.68
12	600016	民生银行	367,100	1,618,911.00	1.67
13	600688	上海石化	412,100	1,549,496.00	1.60
14	600170	上海建工	554,200	1,529,592.00	1.58
15	600023	浙能电力	411,264	1,509,338.88	1.56
16	002146	荣盛发展	261,200	1,473,168.00	1.52
17	601857	中国石油	261,400	1,382,806.00	1.43
18	002233	塔牌集团	132,700	1,364,156.00	1.41
19	000989	九 芝 堂	137,600	1,348,480.00	1.39
20	601398	工商银行	259,800	1,343,166.00	1.39
21	600325	华发股份	198,020	1,334,654.80	1.38
22	001979	招商蛇口	118,500	1,297,575.00	1.34
23	601098	中南传媒	142,618	1,257,890.76	1.30
24	600704	物产中大	140,100	1,102,587.00	1.14
25	600820	隧道股份	202,800	1,072,812.00	1.11
26	601998	中信银行	209,400	1,067,940.00	1.10
27	601886	江河集团	119,600	1,030,952.00	1.07
28	601567	三星医疗	47,600	1,013,880.00	1.05
29	601088	中国神华	51,801	1,011,155.52	1.05
30	600153	建发股份	123,700	1,001,970.00	1.04
31	600479	千金药业	112,420	1,000,538.00	1.03
32	601229	上海银行	121,082	992,872.40	1.03
33	000402	金 融 街	144,120	972,810.00	1.01
34	601939	建设银行	143,600	954,940.00	0.99
35	600900	长江电力	45,400	937,056.00	0.97
36	600642	申能股份	152,100	933,894.00	0.97
37	601668	中国建筑	200,600	932,790.00	0.96

38	300498	温氏股份	64,700	929,739.00	0.96
39	600266	城建发展	188,540	893,679.60	0.92
40	600663	陆家嘴	66,723	888,750.36	0.92
41	600466	蓝光发展	296,300	874,085.00	0.90
42	000778	新兴铸管	230,730	858,315.60	0.89
43	600755	厦门国贸	101,500	833,315.00	0.86
44	601928	凤凰传媒	116,400	831,096.00	0.86
45	600373	中文传媒	82,500	813,450.00	0.84
46	600863	内蒙华电	348,000	810,840.00	0.84
47	601818	光大银行	214,300	810,054.00	0.84
48	600177	雅戈尔	122,402	806,629.18	0.83
49	601333	广深铁路	376,800	798,816.00	0.83
50	601800	中国交建	117,600	762,048.00	0.79
51	600015	华夏银行	122,200	756,418.00	0.78
52	601828	美凯龙	62,540	750,480.00	0.78
53	600000	浦发银行	74,600	746,000.00	0.77
54	600901	江苏租赁	142,400	740,480.00	0.77
55	600018	上港集团	151,200	721,224.00	0.75
56	600048	保利地产	59,600	717,584.00	0.74
57	601992	金隅集团	264,076	710,364.44	0.73
58	002440	闰土股份	79,000	699,150.00	0.72
59	002391	长青股份	99,300	696,093.00	0.72
60	600637	东方明珠	84,400	691,236.00	0.71
61	000156	华数传媒	86,800	669,228.00	0.69
62	000537	广宇发展	126,600	662,118.00	0.68
63	600674	川投能源	52,472	646,979.76	0.67
64	601186	中国铁建	85,900	638,237.00	0.66
65	603458	勘设股份	39,200	635,824.00	0.66
66	600021	上海电力	91,200	630,192.00	0.65
67	000002	万科A	26,400	628,584.00	0.65
68	601009	南京银行	59,600	626,992.00	0.65
69	601318	中国平安	9,700	623,516.00	0.64
70	600795	国电电力	255,700	621,351.00	0.64
71	600210	紫江企业	129,600	615,600.00	0.64
72	000685	中山公用	72,000	587,520.00	0.61
73	002443	金洲管道	93,012	585,975.60	0.61
74	600068	葛洲坝	78,200	585,718.00	0.61
75	600056	中国医药	47,200	573,480.00	0.59
76	601997	贵阳银行	79,810	571,439.60	0.59
77	600585	海螺水泥	13,900	570,595.00	0.59
78	601958	金钼股份	85,900	556,632.00	0.58
79	600252	中恒集团	167,200	550,088.00	0.57

80	601390	中国中铁	103,900	544,436.00	0.56
81	600919	江苏银行	74,800	531,080.00	0.55
82	601000	唐山港	217,400	523,934.00	0.54
83	600639	浦东金桥	37,500	511,875.00	0.53
84	600064	南京高科	54,240	503,889.60	0.52
85	002376	新北洋	55,000	502,700.00	0.52
86	603323	苏农银行	110,000	481,800.00	0.50
87	002039	黔源电力	33,100	479,288.00	0.50
88	000031	大悦城	130,800	470,880.00	0.49
89	600388	龙净环保	53,300	454,116.00	0.47
90	600643	爱建集团	64,600	450,908.00	0.47
91	600027	华电国际	130,500	448,920.00	0.46
92	000651	格力电器	8,600	448,060.00	0.46
93	002061	浙江交科	83,600	443,080.00	0.46
94	600886	国投电力	45,500	437,255.00	0.45
95	601211	国泰君安	25,000	428,500.00	0.44
96	600390	五矿资本	71,600	428,168.00	0.44
97	601985	中国核电	82,900	419,474.00	0.43
98	601933	永辉超市	88,200	417,186.00	0.43
99	601139	深圳燃气	58,300	382,448.00	0.40
100	600125	铁龙物流	76,500	377,145.00	0.39

7.3.2 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	688680	海优新材	608	148,114.88	0.15
2	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.08
3	688317	之江生物	1,189	75,881.98	0.08
4	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.06
5	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.06
6	688276	百克生物	616	48,959.68	0.05
7	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.04
8	688669	聚石化学	1,149	37,216.11	0.04
9	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.04
10	688517	金冠电气	2,840	33,739.20	0.03
11	688611	杭州柯林	756	32,009.04	0.03
12	688499	利元亨	728	28,282.80	0.03
13	688087	英科再生	987	21,674.52	0.02
14	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.02
15	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
16	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
17	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01

18	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
----	--------	------	-----	----------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000036	华联控股	2,927,970.40	2.29
2	603328	依顿电子	2,349,005.00	1.83
3	600376	首开股份	1,783,530.00	1.39
4	000989	九 芝 堂	1,470,099.00	1.15
5	600688	上海石化	1,453,683.00	1.13
6	002233	塔牌集团	1,411,755.00	1.10
7	002110	三钢闽光	1,344,722.00	1.05
8	600466	蓝光发展	1,221,167.00	0.95
9	600565	迪马股份	1,213,413.00	0.95
10	002146	荣盛发展	1,123,985.00	0.88
11	600566	济川药业	1,080,198.00	0.84
12	001979	招商蛇口	963,439.00	0.75
13	601988	中国银行	927,801.00	0.72
14	300498	温氏股份	917,035.27	0.72
15	600048	保利地产	904,613.00	0.71
16	000537	广宇发展	902,217.00	0.70
17	601006	大秦铁路	864,114.00	0.67
18	601800	中国交建	855,280.00	0.67
19	600637	东方明珠	815,350.00	0.64
20	600016	民生银行	808,491.00	0.63

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002110	三钢闽光	2,654,409.00	2.07
2	601003	柳钢股份	2,405,170.00	1.88
3	600019	宝钢股份	2,266,017.00	1.77
4	000898	鞍钢股份	2,225,375.00	1.74
5	000825	太钢不锈	2,198,112.00	1.72
6	000488	晨鸣纸业	1,959,305.00	1.53
7	600188	兖州煤业	1,953,136.00	1.52
8	600808	马钢股份	1,858,186.00	1.45
9	600123	兰花科创	1,530,411.00	1.19
10	600028	中国石化	1,309,988.00	1.02
11	000402	金 融 街	1,224,720.00	0.96

12	600398	海澜之家	1,181,547.00	0.92
13	600971	恒源煤电	1,174,410.40	0.92
14	600395	盘江股份	1,124,198.00	0.88
15	000778	新兴铸管	1,106,364.00	0.86
16	600025	华能水电	971,113.00	0.76
17	600782	新钢股份	970,880.55	0.76
18	601225	陕西煤业	951,471.90	0.74
19	600348	华阳股份	948,249.00	0.74
20	002146	荣盛发展	935,258.00	0.73

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	65,441,380.92
卖出股票收入（成交）总额	67,282,287.83

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	119,000.00	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	119,000.00	0.12

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	113050	南银转债	1,190	119,000.00	0.12

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

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

1、中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”，股票代码：601988, 3988.HK）于 2020 年 12 月 1 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〕60 号)。其因“原油宝”产品风险事件相关违法违规行，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则规定，被处以 5050 万元罚款。

2021 年 5 月 17 日，中国银行因向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款、违规向关系人发放信用贷款、向无资金缺口企业发放流动资金贷款、存款月末冲时点等三十六项违反违规事实，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条，《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第七十四条和相关审慎经营规则，收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书(银保监罚决字〔2021〕11 号)，被处以罚款 8761.355 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银行进行了投资。

2、北京银行股份有限公司（以下简称“北京银行”，股票代码：601169）于 2020 年 12 月 30 日收到北京银保监局出具的行政处罚决定书（京银保监罚决字〔2020〕45 号）。其因对外销售虚假金融产品等多项问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条的规定，被处以 3940 万元罚款。

北京银行于 2020 年 12 月 23 日收到北京银保监局出具的行政处罚决定书（京银保监罚决字〔2020〕41 号）。其因现金管理业务内部控制存在缺陷等问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条的规定，被处以 350 万元罚款。

北京银行于 2020 年 7 月 11 日收到北京银保监局出具的行政处罚决定书（京银保监罚决字〔2020〕23 号）。其因同业投资对资产转让业务承担回购义务，同业投资资产风险分类调整不及时、延缓风险暴露等问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条、第四十八条的规定，被处以 150 万元罚款。

2021 年 2 月 5 日，北京银行因未能确保交易信息的真实性、完整性、可追溯性以及支付全流程中的一致性，未按规定开展条码支付业务等多项违法违规行为，收到中国人民银行营业管理部出具的行政处罚决定书（银管罚〔2021〕4 号），被给予警告，没收违法所得 50.317056 万元，并处罚款 451 万元，罚没合计 501.317056 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北京银行进行了投资。

3、中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”，股票代码：601288、1288.HK）于 2020 年 12 月 7 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〕66 号）。其因收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费）等问题，违反了《中华人民共和国商业银行法》第五十条、《关于银行业金融机构免除部分服务收费的通知》第一条和《中华人民共和国商业银行法》第七十三条的相关规定，被处以没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万元，罚没金额合计 198.36 万元。

农业银行于 2020 年 7 月 13 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字〔2020〕36 号）。其因向关系人发放信用贷款、批量处置不良资产未公告等多项问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》的相关规定，被处以没收违法所得 55.3 万元、罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元。

2021 年 1 月 19 日，农业银行因发生重要信息系统突发事件未报告、制卡数据违规明文留存等多项违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第五项和相关审慎经营规则，收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字〔2021〕1 号），被处以罚款合计 420 万元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对农业银行进行了投资。

4、南京银行股份有限公司（以下简称“南京银行”，股票代码：601009）于 2020 年 12 月 28 日收到人民银行南京分行出具的行政处罚决定书（（南银）罚字〔2020〕第 30 号）。其因未按规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录等多项违法违规行为，被警告，并处罚款 736 万元，没收违法所得人民币 208778.02 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南京银行进行了投资。

5、交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”，股票代码：601328、3328.HK）于 2020 年 7 月 28 日收到上海银保监局出具的行政处罚决定书（沪银保监银罚决字〔2020〕8 号）。其信用卡中心因某客户个人信息未尽安全保护义务、对部分信用卡催收外包管理严重不审慎，被处以 100 万元罚款。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对交通银行进行了投资。

6、其余五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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,055.45
2	应收证券清算款	88,279.51
3	应收股利	—
4	应收利息	434.65
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	103,769.61
---	----	------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 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	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688680	海优新材	148,114.88	0.15	新股流通受限
2	688314	康拓医疗	80,810.80	0.08	新股流通受限
3	688317	之江生物	75,881.98	0.08	新股流通受限
4	688217	睿昂基因	60,736.00	0.06	新股流通受限
5	688616	西力科技	53,990.04	0.06	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 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 (%)
1,590	44,617.31	20,880,424.00	29.43	50,061,105.00	70.57

8.2 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	中国人寿资管—工商银行—国寿资产—低波优选1号保险资产管理产品	10,000,000.00	14.10
2	申万宏源证券—工商银行—申万宏源万利增享1号集合资产管理计划	6,966,800.00	9.82

3	陈健	5,000,000.00	7.05
4	李质健	3,107,000.00	4.38
5	卞志汉	1,810,000.00	2.55
6	中信证券股份有限公司	1,316,922.00	1.86
7	招商证券股份有限公司	1,251,164.00	1.76
8	冯金刚	1,200,000.00	1.69
9	方正证券股份有限公司	1,108,200.00	1.56
10	王宗纲	930,000.00	1.31

8.3 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。

8.4 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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年5月22日） 基金份额总额	1,276,941,529.00
本报告期期初基金份额总额	106,941,529.00
本报告期基金总申购份额	20,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	56,000,000.00
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	70,941,529.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

本基金管理人于2021年3月30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，聘任刘彦春先生担任本公司副总经理。

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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券股份有限公司	2	65,425,946.67	50.44%	60,931.81	50.44%	-
东吴证券股份有限公司	1	47,026,874.46	36.26%	43,798.47	36.26%	本期新增
国泰君安证券股份有限公司	2	16,700,614.00	12.88%	15,553.27	12.88%	-
中信建投证券股份有限公司	1	546,028.85	0.42%	508.64	0.42%	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	186,781.20	100.00%	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-08
2	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	2021-01-15
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
4	景顺长城中证红利低波动 100 交易型	中国证监会指定报刊及	2021-01-21

	开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	网站	
5	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	2021-02-05
6	景顺长城基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-09
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-25
8	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
9	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	2021-03-20
10	关于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新增中国银河证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-23
11	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	2021-03-26
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分公募基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
14	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 2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
15	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 2021 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
16	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基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
17	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基金合同（基金合同更新）	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
18	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	2021-03-30
19	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	2021-04-02
20	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	2021-04-12
21	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	2021-04-15

22	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	2021-04-19
23	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-20
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
25	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 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
26	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-23
27	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
28	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	2021-05-20
29	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-04
30	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-15
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	2021-06-18

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》等法律法规及各基金基金合同、招募说明书及其更新等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，我司对旗下包括本基金在内的 15 只基金的基金合同等法律文件进行修订。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 2021 年 3 月 29 日起正式生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2021 年 3 月 29 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分公募基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引〉修改基金合同等法律文件的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；

2、《景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

4、《景顺长城中证红利低波动 100 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。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2021 年 8 月 23 日