景顺长城大中华混合型证券投资基金
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 基金管理人和基金托管人 5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 6
2.5 信息披露方式 6
2.6 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 8

§4 管理人报告 8

4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 11
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
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 14

§5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 14

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15

6.1 资产负债表 15
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 37

7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 37

7.3 期末按行业分类的权益投资组合 38
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 40
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 45
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 45
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 45
7.11 投资组合报告附注 45

§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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 46

§9 开放式基金份额变动 46

§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 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
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 47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 47
10.8 其他重大事件 52

§11 影响投资者决策的其他重要信息 55

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 55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 55

§12 备查文件目录 56

12.1 备查文件目录 56
12.2 存放地点 56
12.3 查阅方式 56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城大中华混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城大中华混合（QDII）
基金主代码	262001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 22 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	704,506,143.90 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	郭明
	联系电话	0755-82370388	（010）66105799
	电子邮箱	investor@igwfmc.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755-22381339	（010）66105798
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140

法定代表人	李进	陈四清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfmc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	31,374,418.34
本期利润	23,298,427.88
加权平均基金份额本期利润	0.0338
本期加权平均净值利润率	1.33%
本期基金份额净值增长率	11.88%
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	450,228,062.24
期末可供分配基金份额利润	0.6391
期末基金资产净值	1,870,662,392.54
期末基金份额净值	2.655
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	242.40%

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

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

3、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

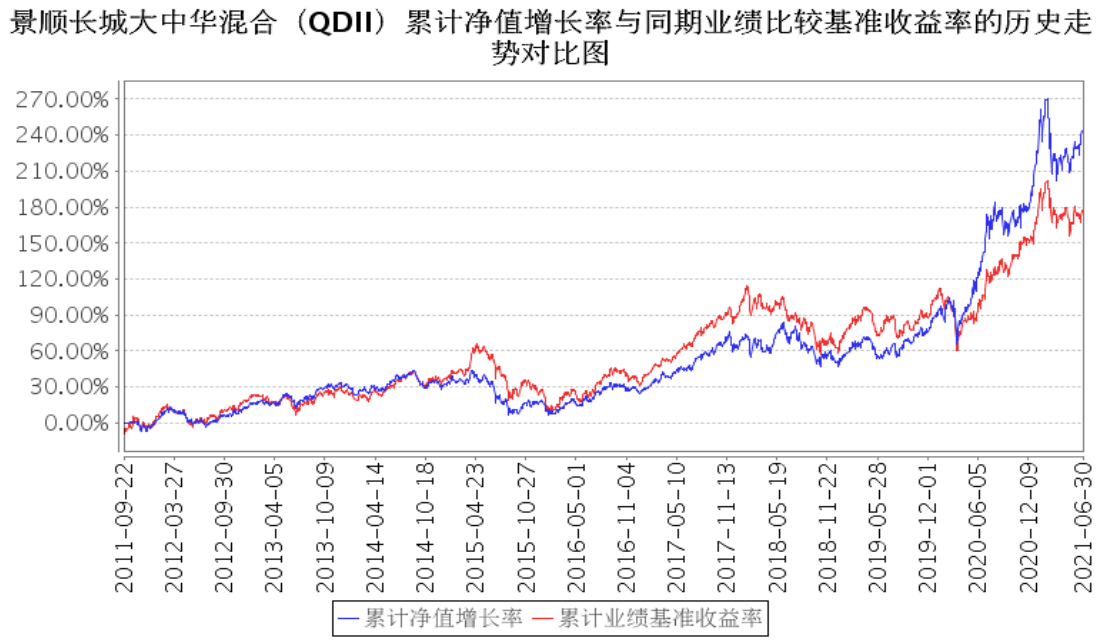
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.98%	1.08%	1.19%	0.95%	3.79%	0.13%
过去三个月	9.08%	1.09%	3.44%	1.06%	5.64%	0.03%
过去六个月	11.88%	1.73%	6.48%	1.33%	5.40%	0.40%
过去一年	38.92%	1.69%	35.98%	1.28%	2.94%	0.41%
过去三年	99.32%	1.47%	46.51%	1.31%	52.81%	0.16%
自基金合同生效起至今	242.40%	1.11%	176.87%	1.15%	65.53%	-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



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

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“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		
周寒颖	本基金的基金经理	2016 年 6 月 3 日	-	15 年	管理学硕士。曾任招商基金研究部研究员、高级研究员、国际业务部高级研究员。2015 年 7 月加入本公司，担任研究部高级研究员，自 2016 年 6 月起担任国际投资部基金经理。具有 15 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
萧光一(MikeShiao)	首席投资总监	29	美国宾夕法尼亚州卓克索大学（Drexel University）金融理学硕士。2002 年加盟景顺，并于 2015 年出任大中华首席投资总监，带领大中华区股票团队，并于 2016 年 4 月担任亚洲区(日本除外)的首席投资总监。萧先生自 2008 年起已为景顺大中华基金的首席基金经理，并于 2014 年 7 月起担任亚洲机遇股票投资组合的首席基金经理。他同时负责中国智选股票等投资组合，以及投资于中国香港/大陆的机构客户投资组合。在此之前，萧先生为中国台湾景顺投信的股票部主管，其后于 2006 年加入位于中国香港的景顺投资管理有限公司，以拓展其覆盖至大中华市场。萧先生在 1992 年开始投身投资业界，在 Grand Regent Investment Ltd.担任项目经理达六年之久，管理中国台湾及大陆的创业基金的活动。他于 1997 年加盟 Overseas Credit and Securities Inc.，担任高级分析员，负责研究中国台湾的科技板块。萧先生亦曾于 Taiwan International Investment Management Co.担任基金经理，负责科技业的研究工作。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年大中华基金收益率为 11.88%，MSCI 金龙指数收益率为 5.68%。其中台湾加权指数上涨 20.52%，恒生指数下跌 3.21%，上证指数上涨 3.40%。同期，纳斯达克指数上涨 12.54%，标普 500 上涨 14.41%。上半年，人民币兑美元贬值 1.2%,6 月 30 日离岸市场人民币对美金汇率 6.46。

回顾上半年持仓，大中华基金平均仓位 86%。行业配置上略负收益，主要来自低配能源和超配通信服务，而工业和医疗保健的超配贡献了正收益。个股选择上取得了正贡献，超额收益主要来自可选消费、金融、工业、房地产、医疗保健和公用事业。

由于德尔塔疫情全球肆虐，经济复苏蒙上一层不确定性，目前非农就业尚未恢复，7 月 12 日的 CPI 数据超预期，经济运行体现为滞涨。此后每个月都要密切跟踪就业率和通胀数据，同时跟踪美联储表态变化。美国通胀和政策走向是下半年宏观主线。随着美国疫苗接种率提升，制造业复工复产就业率上升。接种率提升也会带来服务型消费恢复，美国的通胀将从实物转向服务。

鉴于数字经济呈指数级增长，加强监管是全球趋势。政策方面，互联网行业强监管时代开启。最新监管动态的用意和时机符合全球对数据垄断的担忧以及对技术公司的普遍审查，有利于推进网络安全、数据安全、社会治理并廓清数字主权和司法管辖权，提升资本市场的发展质量，有助于加快中国企业回归本土市场以及监管变革。

我们对行业龙头潜在政策风险进行了前瞻评估和持仓调整，以成长空间、货币化程度、社会影响力等维度进行综合评估，将仓位分散在有限的公司标的上。我们认为在未来一段时间，监管可能将涉及和深入到反垄断与反不正当竞争、违法实施集中和收购审查、成瘾性行业管制与未成年人保护、互联网金融的金融控股公司化、VIE 架构、数据安全与数据隐私、广告信息安全法、市场监管、消费者保护等领域。尽管监管会产生短期不确定性，但规范市场肯定会促进竞争，长远来看鼓励创新，拒绝躺赢。

4.5.2 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 11.88%，业绩比较基准收益率为 6.48%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

数字化浪潮没有结束，从十年前野蛮生长到现在规范发展。政府监管确保继续以低成本、高效率、社会影响正外部性，创新性，更好为实体经济服务、为制造业转型升级助力、为寻常老百姓生活创造福利。有人把互联网强监管比喻成 13 年白酒去三公消费，当年龙头企业利润腰斩，下跌一年后，后面迎来持续健康增长。强监管下，互联网行业经典盈利模式当中的游戏、电商、广告、金融科技等领域利润释放也会受影响，数据加密脱敏对客户画像精准度下降，跨行业扩张的网络效应会有所减弱。但相比传统行业，互联网仍然有一定程度的数字化网络化优势，从 C 端到 B 端，我们更看好互联网下半场，来自产业互联网的机会。

7 月以来，中国娃娃校外培训双减政策强力推出，引发资本市场对民生领域政策不确定的担忧，导致教育、医美、物管、民营医院、消费估值承压。生育率持续下降背后的民生话题，社会内卷引发政策高度关注，也成为 C 端投资的不确定因素。长期而言人口老龄化趋势会加大对服务业需求，在需求加大供给（价格限制、扩张审批、盈利/非盈利）可能受管制背景下，投资机会如何把握权衡，确实是一个新课题，对我们投资形成新挑战。但我们坚信，政策制定者总会找到问题的关键所在，精准制定行业细则，发挥出专业的智慧的光芒。

美国《外国公司问责法》推出和公开上市公司审计委员会（PCAOB）对数据主权的无理要求，预计会有更多的在美上市中概股考虑以第二上市、双重主要上市或再上市方式回归内地或香港市场，同时将有更多的中国拟上市企业选择在内地或香港上市。与此同时，香港市场持续推进一系列改革措施，有利于港交所继续保持改革动力，继续提升新经济占比，港股新经济桥头堡的地位将得以巩固。

围绕数字化、低碳化、国产替代化、老龄化四条主线，港股的工业、科技、可选消费和医药医疗器械领域有很多投资机会待发掘，我们将全力以赴，调动更多内外部资源，打造港股精选个股的核心能力圈。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

与基金会计账目的核对同时进行。

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

相关定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城大中华混合型证券投资基

金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城大中华混合型证券投资基金

报告截止日：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	181,145,572.20	68,379,961.88
结算备付金		130,802,482.50	-
存出保证金		5,833,390.32	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,597,537,942.04	528,341,297.93
其中：股票投资		1,597,537,942.04	528,341,297.93
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		6,371,666.28	-
应收利息	6.4.7.5	17,831.70	2,810.17
应收股利		1,097,751.32	226,712.61
应收申购款		7,599,249.39	8,850,010.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	11,656.54	-
资产总计		1,930,417,542.29	605,800,792.99
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		10,537,702.91	28,528,125.42
应付赎回款		45,142,982.55	7,407,637.12
应付管理人报酬		2,744,992.52	791,989.09
应付托管费		533,748.56	153,997.87

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	535,434.88	-
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	260,288.33	202,242.87
负债合计		59,755,149.75	37,083,992.37
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	704,506,143.90	239,616,056.07
未分配利润	6.4.7.10	1,166,156,248.64	329,100,744.55
所有者权益合计		1,870,662,392.54	568,716,800.62
负债和所有者权益总计		1,930,417,542.29	605,800,792.99

注： 报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 704,506,143.90 份，其中人民币基金份额净值人民币 2.655 元，基金份额总额 697,000,334.31 份；美元基金份额净值美元 0.411 元，基金份额总额 7,505,809.59 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城大中华混合型证券投资基金

本报告期：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 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		52,304,309.16	68,380,075.71
1.利息收入		312,195.76	42,534.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	312,195.76	42,534.43
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		60,160,289.77	15,721,928.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	50,884,322.45	14,605,025.22
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	9,275,967.32	1,116,903.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,075,990.46	52,413,083.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,396,505.32	126,328.58
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,304,319.41	76,200.91
减：二、费用		29,005,881.28	3,258,111.61
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	15,757,179.15	1,939,158.02
2．托管费	6.4.10.2.2	3,063,895.97	377,058.48
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.19	10,053,509.72	846,603.76
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	6.4.7.20	131,296.44	95,291.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,298,427.88	65,121,964.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,298,427.88	65,121,964.10

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城大中华混合型证券投资基金

本报告期：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）	239,616,056.07	329,100,744.55	568,716,800.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	23,298,427.88	23,298,427.88
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）	464,890,087.83	813,757,076.21	1,278,647,164.04
其中：1.基金申购款	825,414,126.91	1,372,152,866.62	2,197,566,993.53

2.基金赎回款	-360,524,039.08	-558,395,790.41	-918,919,829.49
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）	704,506,143.90	1,166,156,248.64	1,870,662,392.54
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 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）	102,003,188.43	61,156,522.27	163,159,710.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	65,121,964.10	65,121,964.10
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）	59,971,466.21	45,667,549.61	105,639,015.82
其中：1.基金申购款	93,942,564.50	68,535,929.72	162,478,494.22
2.基金赎回款	-33,971,098.29	-22,868,380.11	-56,839,478.40
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）	-	-10,216,336.54	-10,216,336.54
五、期末所有者权益（基金净值）	161,974,654.64	161,729,699.44	323,704,354.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐	吴建军	邵媛媛
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城大中华混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 709 号《关于核准景顺长城大中华股票型证券投资基金募集的批复》核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城大中华股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限

不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 291,060,560.03 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 367 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城大中华股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 291,092,562.55 份基金份额，其中认购资金利息折合 32,002.52 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为渣打银行（香港）有限公司(Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited)。

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

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 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》、《景顺长城大中华混合型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 2021 年 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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府

债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	181,145,572.20
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	181,145,572.20

注：于 2021 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 103,673,248.25 元(折合人民币 86,264,436.40 元)，美元 608,145.03 元(折合人民币 3,928,677.71 元)，新台币 5,264,323.00 元(折合人民币 1,220,107.38 元)。

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		1,473,489,965.11	1,597,537,942.04	124,047,976.93
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,473,489,965.11	1,597,537,942.04	124,047,976.93

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	11,692.38
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	6,139.32
应收债券利息	-
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	-
合计	17,831.70

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	11,656.54
合计	11,656.54

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	535,434.88
银行间市场应付交易费用	-
合计	535,434.88

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	168,548.48
应付证券出借违约金	-
预提费用	91,739.85
合计	260,288.33

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	239,616,056.07	239,616,056.07
本期申购	825,414,126.91	825,414,126.91
本期赎回（以“-”号填列）	-360,524,039.08	-360,524,039.08
- 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	704,506,143.90	704,506,143.90

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	136,312,178.47	192,788,566.08	329,100,744.55
本期利润	31,374,418.34	-8,075,990.46	23,298,427.88
本期基金份额交易产生的变动数	282,541,465.43	531,215,610.78	813,757,076.21
其中：基金申购款	527,944,897.55	844,207,969.07	1,372,152,866.62
基金赎回款	-245,403,432.12	-312,992,358.29	-558,395,790.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	450,228,062.24	715,928,186.40	1,166,156,248.64

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	272,115.76
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	26,817.06
其他	13,262.94
合计	312,195.76

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,147,049,667.95
减：卖出股票成本总额	2,096,165,345.50
买卖股票差价收入	50,884,322.45

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 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	9,275,967.32
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	9,275,967.32

6.4.7.17 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	-8,075,990.46
股票投资	-8,075,990.46
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	-8,075,990.46

6.4.7.18 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	1,304,319.41
合计	1,304,319.41

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

6.4.7.19 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	10,053,509.72
银行间市场交易费用	-
合计	10,053,509.72

6.4.7.20 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	32,232.48

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
税务代理费	11,490.69
银行划款手续费	28,065.90
合计	131,296.44

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
渣打银行(香港)有限公司(“渣打银行”)	境外资产托管人
长城证券股份有限公司(“长城证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
长城证券	23,216,084.94	0.45	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
长城证券	18,572.71	0.39	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
长城证券	-	-	-	-

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。

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 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	15,757,179.15	1,939,158.02
其中：支付销售机构的客户维护费	3,782,188.20	308,276.13

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

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,063,895.97	377,058.48

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

日托管费＝前一日基金资产净值×0.35%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

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1月1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
渣打银行-活期	87,489,758.38	11,257.21	22,573,678.60	731.26
中国工商银行-活期	93,655,813.82	260,858.55	9,010,200.38	41,742.86

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期未进行利润分配。

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
9868HK	小鹏汽车-W	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	137.29	137.29	130,200	17,875,574.64	17,875,574.64	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
03800	保利协鑫能源	2021 年 4 月 1 日	重大事项停牌	1.65	-	-	19,523,000	43,971,096.80	32,164,501.72	-

注：本基金截至 2021 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券（上年末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金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 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，并按照合约规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 2021 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	93,655,813.82	-	-	-	-	87,489,758.38	181,145,572.20
结算备付金	130,802,482.50	-	-	-	-	-	130,802,482.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,597,537,942.04	1,597,537,942.04
应收利息	-	-	-	-	-	17,831.70	17,831.70
应收股利	-	-	-	-	-	1,097,751.32	1,097,751.32
应收申购款	6,275.78	-	-	-	-	7,592,973.61	7,599,249.39
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,371,666.28	6,371,666.28

其他资产	-	-	-	-	-	5,845,046.86	5,845,046.86
资产总计	224,464,572.10	-	-	-	-	1,705,952,970.19	1,930,417,542.29
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	45,142,982.55	45,142,982.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,744,992.52	2,744,992.52
应付托管费	-	-	-	-	-	533,748.56	533,748.56
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,537,702.91	10,537,702.91
应付交易费用	-	-	-	-	-	535,434.88	535,434.88
其他负债	-	-	-	-	-	260,288.33	260,288.33
负债总计	-	-	-	-	-	59,755,149.75	59,755,149.75
利率敏感度缺口	224,464,572.10	-	-	-	-	-	-
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	33,441,407.41	-	-	-	-	34,938,554.47	68,379,961.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-	528,341,297.93	528,341,297.93
应收利息	-	-	-	-	-	2,810.17	2,810.17
应收股利	-	-	-	-	-	226,712.61	226,712.61
应收申购款	14.90	-	-	-	-	8,849,995.50	8,850,010.40
资产总计	33,441,422.31	-	-	-	-	572,359,370.68	605,800,792.99
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,407,637.12	7,407,637.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	791,989.09	791,989.09
应付托管费	-	-	-	-	-	153,997.87	153,997.87
应付证券清算款	-	-	-	-	-	28,528,125.42	28,528,125.42
其他负债	-	-	-	-	-	202,242.87	202,242.87
负债总计	-	-	-	-	-	37,083,992.37	37,083,992.37
利率敏感度缺口	33,441,422.31	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有债券资产（上年末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	3,928,677.71	86,264,436.40	1,220,107.38	91,413,221.49
交易性金融资产	82,532,251.37	1,418,611,764.99	96,393,925.68	1,597,537,942.04
应收利息	10.72	-	-	10.72
应收股利	-	724,908.10	324,013.20	1,048,921.30
应收申购款	59,337.96	-	-	59,337.96
其他资产	11,656.54	-	-	11,656.54
资产合计	86,531,934.30	1,505,601,109.49	97,938,046.26	1,690,071,090.05
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	10,537,702.91	-	10,537,702.91
负债合计	-	10,537,702.91	-	10,537,702.91
资产负债表外汇风险敞口净额	86,531,934.30	1,495,063,406.58	97,938,046.26	1,679,533,387.14
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	6,535,103.64	34,807,589.49	125,704.94	41,468,398.07
交易性金融资产	21,680,098.09	468,872,750.69	37,788,449.15	528,341,297.93
应收利息	1.83	-	-	1.83
应收股利	-	105,945.64	120,766.97	226,712.61

资产合计	28,215,203.56	503,786,285.82	38,034,921.06	570,036,410.44
以外币计价的负债				
应付证券清算款	1,097,190.58	27,430,928.49	-	28,528,119.07
负债合计	1,097,190.58	27,430,928.49	-	28,528,119.07
资产负债表外汇风险敞口净额	27,118,012.98	476,355,357.33	38,034,921.06	541,508,291.37

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率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	所有外币均相对人民币升值 5%	83,976,669.36	27,075,414.57
	所有外币均相对人民币贬值 5%	-83,976,669.36	-27,075,414.57

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，所面临的最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	1,597,537,942.04	85.40	528,341,297.93	92.90
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	1,597,537,942.04	85.40	528,341,297.93	92.90

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%	60,429,592.43	22,717,062.27
	沪深 300 指数下降 5%	-60,429,592.43	-22,717,062.27

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 1,547,497,865.68 元，属于第二层次的余额为 50,040,076.36 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 528,341,297.93 元，无第二或第三层次)。

(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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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)　除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	1,597,537,942.04	82.76
	其中：普通股	1,515,005,690.67	78.48
	存托凭证	82,532,251.37	4.28
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	311,948,054.70	16.16
8	其他各项资产	20,931,545.55	1.08
9	合计	1,930,417,542.29	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 749,408,412.86 元，占基金资产净值比例为 40.06%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	1,418,611,764.99	75.83
中国台湾	96,393,925.68	5.15

美国	82,532,251.37	4.41
合计	1,597,537,942.04	85.40

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
原材料	-	-
周期性消费品	165,623,710.07	8.85
非周期性消费品	370,966,188.95	19.83
综合	-	
能源	32,164,501.72	1.72
金融	219,494,324.12	11.73
工业	224,958,744.09	12.03
信息科技	277,462,222.10	14.83
公用事业	-	
通讯	306,868,250.99	16.40
合计	1,597,537,942.04	85.40

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	286,700	139,317,484.22	7.45
2	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	东方海外国际	316 HK	香港联合交易所	中国香港	815,500	114,134,000.57	6.10
3	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	微创医疗	853 HK	香港联合交易所	中国香港	1,706,000	98,870,158.63	5.29
4	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	中车时代电气	3898 HK	香港联合交易所	中国香港	2,556,900	97,654,331.66	5.22
5	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING LTD	台积电	2330 TT	台湾证券交易所	中国台湾	699,000	96,393,925.68	5.15
6	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际	354 HK	香港联合交易所	中国香港	8,154,000	96,072,489.33	5.14
7	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	中教控股	839 HK	香港联合交易所	中国香港	6,498,000	93,646,743.15	5.01
8	Bilibili Inc	哔哩哔哩	9626 HK	香港联合交易所	中国香港	106,850	84,995,807.09	4.54
9	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华控股	1999 HK	香港联合交易所	中国香港	4,564,000	70,863,460.82	3.79
1	INNOVENT BIOLOGICS	信达生物	1801 HK	香港联合	中国香港	864,500	65,135,617.64	3.48

0	INC			交易所				
11	MEITUAN DIANPING	美团点评	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	214,300	57,132,043.98	3.05
12	Jinke Smart Services Group Co	金科服务	9666 HK	香港联合交易所	中国香港	942,400	57,125,487.19	3.05
13	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港交易所	388 HK	香港联合交易所	中国香港	144,700	55,722,034.49	2.98
14	Futu Holdings LTD	富途控股	FUTU US	美国证券交易所	美国	39,270	45,433,006.66	2.43
15	CHINA MOBILE LTD	中国移动	941 HK	香港联合交易所	中国香港	1,122,000	45,325,977.05	2.42
16	CHINA INTERNATIONAL CAPITA	中金公司	3908 HK	香港联合交易所	中国香港	2,594,400	45,117,840.56	2.41
17	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	药明生物	2269 HK	香港联合交易所	中国香港	362,000	42,862,604.21	2.29
18	Pinduoduo Inc	拼多多	PDD US	美国证券交易所	美国	45,212	37,099,244.71	1.98
19	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	申洲国际	2313 HK	香港联合交易所	中国香港	226,000	36,876,620.69	1.97
20	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能源	3800 HK	香港联合交易所	中国香港	19,523,000	32,164,501.72	1.72
21	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP	福耀玻璃	3606 HK	香港联合交易所	中国香港	628,400	28,601,485.24	1.53
22	CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	宇华教育	6169 HK	香港联合交易所	中国香港	3,438,000	20,110,658.01	1.08
23	Aidigong Maternal & Child Heal	爱帝宫	286 HK	香港联合交易所	中国香港	18,736,000	18,863,719.56	1.01
24	XPENG INC	小鹏汽车-W	9868 HK	香港联合交易所	中国香港	130,200	17,875,574.64	0.96
25	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	石药集团	1093 HK	香港联合交易所	中国香港	1,906,000	17,826,015.96	0.95
26	XIAOMI CORP-CLASS B	小米集团	1810 HK	香港联合交易所	中国香港	735,600	16,526,107.30	0.88
27	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	绿城服务	2869 HK	香港联合交易所	中国香港	1,604,000	16,095,955.22	0.86
28	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技	2382 HK	香港联合交易所	中国香港	64,500	13,170,411.86	0.70
29	WEIMOB INC	微盟集团	2013 HK	香港联合交易所	中国香港	805,000	11,467,393.73	0.61
30	Bosideng International Holdings LTD	波司登	3998 HK	香港联合交易所	中国香港	2,470,000	11,406,568.68	0.61
3	Angelalign Technology	时代天使	6699 HK	香港联合	中国香港	27,800	9,266,608.69	0.50

1	Inc			交易所				
32	Remegen Co Ltd	荣昌生物-B	9995 HK	香港联合交易所	中国香港	44,500	4,384,063.10	0.23

注：本基金对以上证券代码采用彭博代码即 BB Ticker。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	MEITUAN DIANPING	3690 HK	152,265,753.16	26.77
2	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	151,982,633.14	26.72
3	Bilibili Inc	9626 HK	76,133,842.58	13.39
3	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	BILI US	65,625,913.97	11.54
4	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	126,490,706.77	22.24
5	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	118,018,801.08	20.75
6	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	115,425,508.19	20.30
7	WEIMOB INC	2013 HK	114,220,242.98	20.08
8	CHINA MOBILE LTD	941 HK	112,269,264.87	19.74
9	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	354 HK	94,140,422.24	16.55
10	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	92,579,045.48	16.28
11	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	839 HK	86,385,345.72	15.19
12	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	316 HK	85,961,358.15	15.11
13	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1308 HK	76,191,777.39	13.40
14	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	75,774,647.80	13.32
15	MAN WAH HOLDINGS LTD	1999 HK	71,970,416.71	12.65
16	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1 HK	70,099,164.40	12.33
17	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	3898 HK	67,253,395.05	11.83

18	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3606 HK	65,629,018.78	11.54
19	SMOOREINTERNATIONALHOLDING	6969 HK	64,371,158.93	11.32
20	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2689 HK	64,101,718.52	11.27
21	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	3908 HK	61,680,114.96	10.85
22	JD.comInc.	9618 HK	58,578,768.21	10.30
23	Haier Smart Home Co Ltd	6690 HK	56,234,147.82	9.89
24	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	55,733,614.50	9.80
25	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	3800 HK	55,390,850.43	9.74
26	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2330 TT	53,596,889.62	9.42
27	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	39,683,139.39	6.98
27	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	13,771,707.63	2.42
28	Jinke Smart Services Group Co	9666 HK	52,192,950.86	9.18
29	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	45,784,770.42	8.05
30	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	44,895,643.92	7.89
31	HOPE EDUCATION GROUP CO LTD	1765 HK	42,007,200.18	7.39
32	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	41,470,145.39	7.29
33	FUTU HOLDINGS LIMITED	FUTU US	39,321,044.29	6.91
34	TAL EDUCATION GROUP- ADR	TAL US	38,638,559.60	6.79
35	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	37,528,348.03	6.60
36	PINDUODUO INC-ADR	PDD US	36,891,830.36	6.49
37	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	968 HK	36,544,097.27	6.43
38	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	1209 HK	34,695,122.26	6.10
39	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	868 HK	34,675,102.30	6.10

40	CHINA EAST EDUCATION HOLDING	667 HK	33,657,479.45	5.92
41	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	33,344,932.86	5.86
42	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	522 HK	26,618,212.74	4.68
43	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	2869 HK	25,434,906.44	4.47
44	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	24,569,408.93	4.32
45	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	18,780,302.72	3.30
46	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	VIPS US	18,546,882.92	3.26
47	Aidigong Maternal & Child Heal	286 HK	18,389,098.41	3.23
48	CHINA FEIHE LTD	6186 HK	18,248,237.83	3.21
49	XPENG INC	9868 HK	17,875,574.64	3.14
50	EDVANTAGE GROUP HOLDINGS LTD	382 HK	17,029,029.88	2.99
51	TIANGONG INTL CO LTD	826 HK	15,378,148.45	2.70
52	Remegen Co Ltd	9995 HK	14,304,944.92	2.52
53	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	916 HK	13,719,851.66	2.41
54	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC.	2018 HK	12,809,867.37	2.25

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	WEIMOB INC	2013 HK	126,677,974.42	22.27
2	MEITUAN DIANPING	3690 HK	110,394,638.65	19.41
3	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1308 HK	105,983,169.32	18.64
4	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	100,258,682.64	17.63
5	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	86,510,525.79	15.21
6	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	72,960,915.23	12.83
7	SHENZHOU	2313 HK	71,682,912.37	12.60

	INTERNATIONAL GROUP			
8	JD.comInc.	9618 HK	71,365,235.09	12.55
9	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1 HK	66,377,363.35	11.67
10	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	BILI US	61,313,878.02	10.78
11	SMOOREINTERNATIONALHOLDING	6969 HK	58,574,335.40	10.30
12	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3606 HK	57,833,196.59	10.17
13	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	968 HK	57,789,834.17	10.16
14	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	56,764,591.15	9.98
15	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	55,724,553.95	9.80
16	CHINA MOBILE LTD	941 HK	53,810,231.78	9.46
17	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	53,753,015.73	9.45
18	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	39,898,904.30	7.02
18	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	12,478,784.13	2.19
19	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2689 HK	47,470,124.82	8.35
20	Haier Smart Home Co Ltd	6690 HK	46,607,562.19	8.20
21	HOPE EDUCATION GROUP CO LTD	1765 HK	42,426,432.73	7.46
22	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	868 HK	41,541,661.48	7.30
23	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	41,500,662.61	7.30
24	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	1209 HK	40,109,146.83	7.05
25	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	3800 HK	35,798,004.93	6.29
26	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	34,496,893.44	6.07
27	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	34,145,634.32	6.00
28	TAL EDUCATION GROUP- ADR	TAL US	34,139,587.16	6.00
29	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	30,259,853.58	5.32

30	CHINA EAST EDUCATION HOLDING	667 HK	28,040,944.64	4.93
31	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	522 HK	24,564,345.20	4.32
32	TIANGONG INTL CO LTD	826 HK	23,946,247.24	4.21
33	FUTU HOLDINGS LIMITED	FUTU US	22,129,344.58	3.89
34	CHINA FEIHE LTD	6186 HK	19,707,897.18	3.47
35	MAN WAH HOLDINGS LTD	1999 HK	19,001,219.95	3.34
36	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	354 HK	18,492,700.41	3.25
37	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	17,912,991.39	3.15
38	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	16,570,893.60	2.91
39	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	VIPS US	16,460,562.40	2.89
40	EDVANTAGE GROUP HOLDINGS LTD	382 HK	15,010,320.64	2.64
41	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	14,645,068.36	2.58
42	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC.	2018 HK	14,392,313.87	2.53
43	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2688 HK	13,531,499.39	2.38
44	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	3908 HK	12,962,378.75	2.28
45	CITIC SECURITIES CO LTD-H	6030 HK	12,757,413.29	2.24
46	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	916 HK	12,275,894.04	2.16

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	3,173,437,980.07
卖出收入（成交）总额	2,147,049,667.95

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

7.11 投资组合报告附注

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

1、腾讯控股有限公司（以下简称“腾讯控股”，股票代码：00700.HK）于 2021 年 3 月 12 日收到市场监管总局的行政处罚决定书(国市监处〔2021〕13 号)。其因价格垄断违反《中华人民共和国反垄断法》相关规定，被处以罚款人民币 50 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腾讯控股进行了投资。

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

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,833,390.32
2	应收证券清算款	6,371,666.28
3	应收股利	1,097,751.32
4	应收利息	17,831.70
5	应收申购款	7,599,249.39
6	其他应收款	-

7	待摊费用	11,656.54
8	其他	-
9	合计	20,931,545.55

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
150,967	4,666.62	258,023,078.69	36.62	446,483,065.21	63.38

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	707,041.96	0.100360

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

1.本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

2.本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 9 月 22 日）基金份额总额	291,092,562.55
本报告期期初基金份额总额	239,616,056.07
本报告期基金总申购份额	825,414,126.91
减：本报告期基金总赎回份额	360,524,039.08
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	704,506,143.90

§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：

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”） 根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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	
Haitong International Securities Company Limited	1	841,339,293.83	16.19%	724,222.50	15.09%	-
China International Capital Corporation Limited	1	824,943,038.93	15.87%	692,169.18	14.43%	-
海通证券股份有限公司	1	700,506,034.36	13.48%	560,409.04	11.68%	-
Credit Suisse Hong Kong Limited	1	578,734,142.35	11.13%	578,734.15	12.06%	-
中国银河证券股份有限公司	1	570,299,591.10	10.97%	456,239.64	9.51%	-
CLSA	1	402,559,122.39	7.74%	638,770.00	13.31%	-
Citigroup Global Markets Asia Limited	1	352,088,931.80	6.77%	384,060.98	8.00%	-
中国国际金融股份有限公司	2	345,519,512.23	6.65%	276,415.91	5.76%	-
瑞银证券有限责任公司	1	108,785,568.81	2.09%	87,027.98	1.81%	-
瑞信证券（中国）有限公司	2	89,590,511.84	1.72%	71,672.59	1.49%	-
Masterlink Securities Corporation	1	53,596,889.62	1.03%	64,315.98	1.34%	-
安信证券股份有限公司	1	52,271,901.61	1.01%	41,817.22	0.87%	-
兴业证券股份有限公司	1	45,598,419.11	0.88%	36,478.76	0.76%	-
天风证券股份有限公司	1	44,225,401.97	0.85%	35,380.14	0.74%	-
太平洋证券股份有限公司	1	41,278,064.18	0.79%	33,022.56	0.69%	-
国盛证券有限责任公司	1	33,562,349.91	0.65%	26,849.57	0.56%	-
中信证券股份有限公司	2	29,266,986.16	0.56%	23,413.94	0.49%	-

方正证券股份有限公司	2	27,557,537.78	0.53%	22,045.890	0.46%	-
长城证券股份有限公司	1	23,216,084.94	0.45%	18,572.71	0.39%	-
国海证券股份有限公司	1	18,371,628.15	0.35%	14,697.19	0.31%	-
平安证券股份有限公司	1	14,497,599.76	0.28%	11,597.97	0.24%	-
Yuanta securities company limited	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
ICBC Internation	1	-	-	-	-	-

al Holdings Limited						
United Bank of Switzerland	1	-	-	-	-	本期新增
China Renaissance	1	-	-	-	-	本期新增

注：1、本基金与景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金共用交易单元。

2、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1）选择标准

a、资金实力雄厚，信誉良好；

b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；

d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；

e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2）选择程序

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Haitong International Securities Company Limited								
China International Capital Corporation Limited								
海通证券股份有限公司								
Credit Suisse Hong								

Kong Limited								
中国银河证券股份有限公司								
CLSA								
Citigroup Global Markets Asia Limited								
中国国际金融股份有限公司								
瑞银证券有限责任公司								
瑞信证券（中国）有限公司								
Masterlink Securities Corporation								
安信证券股份有限公司								
兴业证券股份有限公司								
天风证券股份有限公司								
太平洋证券股份有限公司								
国盛证券有限责任公司								
中信证券股份有限公司								
方正证券股份有限公司								
长城证券股份有限公司								
国海证券股份有限公司								
平安证券股份有限公司								
Yuanta securities company limited								
北京高华证券有限责任公司								
第一创业证券股份有限公司								
东方证券股份有限公司								
东亚前海证券有限责任公司								
国都证券股份有限公司								
国金证券股份有限公司								
国泰君安证券股份有限公司								
恒泰证券股份有限公司								
华创证券有限责任公司								
华西证券股份有限公司								
民生证券股份有限公司								

申港证券股份有限公司								
申万宏源证券有限公司								
东方财富证券股份有限公司								
招商证券股份有限公司								
中信建投证券股份有限公司								
ICBC International Holdings Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
United Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	-	-
China Renaissance	-	-	-	-	-	-	-	-

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	关于景顺长城大中华混合型证券投资基金 2021 年境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）和赎回业务安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加财通证券股份有限公司申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
4	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
5	景顺长城基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统招行直联渠道基金交易费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-20
6	景顺长城大中华混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
7	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
8	关于景顺长城大中华混合型证券投资基金人民币基金份额在广发证券开通基金定期定额投资业务及参加定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-26
9	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-04
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2021-02-05

	停机维护的公告	网站	
11	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
12	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-25
13	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-25
14	关于旗下部分基金新增中欧财富为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-09
15	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
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加安信证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-15
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国国际金融股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-19
18	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
19	关于旗下部分基金新增阳光人寿保险股份有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-25
20	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
21	景顺长城大中华混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
22	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
23	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
24	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-31
25	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

26	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
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	2021-04-15
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	2021-04-19
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	2021-04-20
30	景顺长城大中华混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
31	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
32	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-23
33	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-27
34	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
35	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-17
36	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增青岛银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-19
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	2021-05-20
38	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
39	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
40	景顺长城大中华混合型证券投资基金 2021 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
41	景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
42	景顺长城大中华混合型证券投资基金托管协议更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
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	2021-06-18
44	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购（含日	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-29

	常申购和定期定额投资）、赎回业务的公告		

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20210101-20210120	72,000,000.00	-	-	72,000,000.00	10.22
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。							

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侧袋机制指引（试行）》等法律

法规及本基金基金合同等规定，经与各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决定对本基金的基金合同等法律文件进行修订，新增侧袋机制相关内容。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 6 月 18 日起正式生效。有关详细信息参见本公司于 2021 年 6 月 18 日发布的相关公告。

§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大中华股票型证券投资基金募集注册的文件；

2、《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》；

3、《景顺长城大中华混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《景顺长城大中华混合型证券投资基金托管协议》；

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2021 年 8 月 23 日