

景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 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	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	12
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	13
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	13
§ 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	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46

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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 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	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城量化小盘股票
基金主代码	005457
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 2 月 6 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	113,582,119.02 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型精选股票，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略： 本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略： 本基金主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。</p> <p>3、债券投资策略： 出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
		李申
		021-60637102
		lishen.zh@ccb.com

客户服务电话	4008888606	021-60637111
传真	0755-22381339	021-60635778
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	李进	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	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	14,293,899.20
本期利润	25,100,681.04
加权平均基金份额本期利润	0.2572
本期加权平均净值利润率	17.49%
本期基金份额净值增长率	17.79%
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	72,564,277.30
期末可供分配基金份额利润	0.6389
期末基金资产净值	186,146,396.32
期末基金份额净值	1.6388
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	63.88%

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四位，小数点后第五位舍去，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	5.96%	0.84%	3.76%	0.97%	2.20%	-0.13%
过去三个月	13.51%	0.76%	11.91%	0.84%	1.60%	-0.08%
过去六个月	17.79%	1.02%	6.29%	1.10%	11.50%	-0.08%
过去一年	39.70%	1.30%	11.60%	1.32%	28.10%	-0.02%
过去三年	73.71%	1.49%	25.45%	1.50%	48.26%	-0.01%
自基金合同生效起至今	63.88%	1.49%	9.73%	1.50%	54.15%	-0.01%

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

景顺长城量化小盘股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，投资于小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-20%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的建仓期为自 2018 年 2 月 6 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 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

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		
黎海威	本基金的基金经理	2018 年 2 月 6 日	-	18 年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有 18 年海内外证券、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、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 年上半年，随着发达国家疫苗接种的持续推进，全球疫情逐步得到有效控制，在美国政府新一轮刺激计划的带动下，海外需求继续快速修复，大宗商品价格出现大幅上涨。6 月国内工业增加值累计同比上涨 15.9%，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 51.1、51.0、50.9，经济扩张动能边际减弱。6 月 PPI 同比上涨 8.8%，环比上涨 0.3%；CPI 同比上涨 1.1%，环比下跌 0.4%，PPI 同比高点已现，通胀预期有所缓和。6 月 M2 同比增速 8.6%，M1 同比增速 5.5%，国内货币政策总体保持稳健，流动性合理适度，宏观环境总体温和。6 月社融增速 11%，信贷社融数据保持稳定。6 月末外汇储备 3.2 万亿美元，汇率维持平稳。上半年 A 股权益市场出现大幅波动，一季度美债收益率的快速抬升使得核心资产出现连续下跌，二季度市场风险偏好有所提升，景气度较高的成长板块表现突出，综合来看，上半年上证指数上涨 3.4%，沪深 300 上涨 0.24%，而以医药和科技为代表的创业板指表现强势，上涨 17.22%。

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 17.79%，业绩比较基准收益率为 6.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，上半年韧性较高的地产投资和景气程度较强的出口在下半年均有回落风险，经济扩张动能减弱的趋势或维持，我们对宏观场景的判断仍然是“稳货币、紧信用”。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。权益市场仍具备结构性配置机会，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。我们的投资组合仍然会维持价值和成长之间的平衡，

同时关注现金流良好和内生成长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生长期投资回报。

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应用性的情况时，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合规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

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	15,325,513.89	9,728,732.65
结算备付金		462,018.55	550,625.42
存出保证金		25,521.72	42,642.36
交易性金融资产	6.4.7.2	170,502,757.56	130,519,259.84
其中：股票投资		170,388,188.36	130,519,259.84
基金投资		-	-
债券投资		114,569.20	-
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		-	168,282.69
应收利息	6.4.7.5	1,618.84	1,223.81

应收股利		-	-
应收申购款		2,552,334.99	36,479.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		188,869,765.55	141,047,245.95
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		1,300,034.28	-
应付赎回款		622,382.89	884,996.60
应付管理人报酬		197,894.57	180,624.45
应付托管费		32,982.42	30,104.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	482,883.76	419,006.12
应交税费		0.59	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	87,190.72	175,387.58
负债合计		2,723,369.23	1,690,118.82
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	113,582,119.02	100,162,131.71
未分配利润	6.4.7.10	72,564,277.30	39,194,995.42
所有者权益合计		186,146,396.32	139,357,127.13
负债和所有者权益总计		188,869,765.55	141,047,245.95

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.6388 元，基金份额总额 113,582,119.02 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

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	上年度可比期间
		2021年1月1日至2021年 6月30日	2020年1月1日至2020年 6月30日
一、收入		27,816,673.44	49,165,280.93
1. 利息收入		25,072.66	75,948.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	25,000.40	75,891.44

债券利息收入		72.26	57.25
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）		16,836,184.10	41,736,888.12
其中：股票投资收益	6.4.7.12	15,403,352.59	39,987,187.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	29,209.48	139,787.56
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	1,403,622.03	1,609,912.63
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	10,806,781.84	7,120,401.73
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	148,634.84	232,042.39
减：二、费用		2,715,992.40	4,523,105.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,063,408.26	1,897,392.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	177,234.72	316,232.09
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,384,250.53	2,213,664.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.21	0.20
7. 其他费用	6.4.7.19	91,098.68	95,817.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,100,681.04	44,642,174.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,100,681.04	44,642,174.96

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

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)	100,162,131.71	39,194,995.42	139,357,127.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,100,681.04	25,100,681.04
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)	13,419,987.31	8,268,600.84	21,688,588.15
其中：1. 基金申购款	68,396,463.25	33,048,479.10	101,444,942.35
2. 基金赎回款	-54,976,475.94	-24,779,878.26	-79,756,354.20
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)	113,582,119.02	72,564,277.30	186,146,396.32
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)	372,182,378.29	-8,661,877.41	363,520,500.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	44,642,174.96	44,642,174.96
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)	-214,544,792.91	-8,681,399.01	-223,226,191.92
其中：1. 基金申购款	35,239,488.73	996,547.08	36,236,035.81
2. 基金赎回款	-249,784,281.64	-9,677,946.09	-259,462,227.73

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）	157,637,585.38	27,298,898.54	184,936,483.92

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

景顺长城量化小盘股票型证券投资基金（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[2017]第 2169 号《关于准予景顺长城量化小盘股票型证券投资基金注册的批复》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《景顺长城量化小盘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人民币 1,783,703,963.03 元，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（2018）第 0090 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,784,551,427.10 份基金份额，其中认购资金利息折合 847,464.07 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化小盘股票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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债等）、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规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）。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为 80-95%，投资于小盘股票的比例不低于非现金基金资产

的 80%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-20%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需要缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 X95%+银行活期存款利率(税后)X5%。

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》、《景顺长城量化小盘股票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 日止期间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	15,325,513.89
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	15,325,513.89

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	161,349,768.77	170,388,188.36	9,038,419.59
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	109,000.00	114,569.20
	银行间市场	-	-
	合计	109,000.00	114,569.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	161,458,768.77	170,502,757.56	9,043,988.79

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	1,362.89
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	187.20
应收债券利息	58.40
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	10.35
合计	1,618.84

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	482,883.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	482,883.76

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	410.27
应付证券出借违约金	-
预提费用	86,780.45
合计	87,190.72

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	100,162,131.71	100,162,131.71
本期申购	68,396,463.25	68,396,463.25
本期赎回（以“-”号填列）	-54,976,475.94	-54,976,475.94
- 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	113,582,119.02	113,582,119.02

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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	58,855,331.16	-19,660,335.74	39,194,995.42
本期利润	14,293,899.20	10,806,781.84	25,100,681.04
本期基金份额交易产生的变动数	9,997,768.56	-1,729,167.72	8,268,600.84
其中：基金申购款	43,965,395.28	-10,916,916.18	33,048,479.10
基金赎回款	-33,967,626.72	9,187,748.46	-24,779,878.26

本期已分配利润	-	-	-
本期末	83,146,998.92	-10,582,721.62	72,564,277.30

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	19,443.51
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	5,360.60
其他	196.29
合计	25,000.40

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	448,243,504.21
减：卖出股票成本总额	432,840,151.62
买卖股票差价收入	15,403,352.59

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	206,225.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	177,000.00
减：应收利息总额	15.52
买卖债券差价收入	29,209.48

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	1,403,622.03
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	1,403,622.03

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	10,806,781.84
股票投资	10,801,212.64
债券投资	5,569.20
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	10,806,781.84

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	138,766.88
基金转换费收入	9,867.96
合计	148,634.84

注：1. 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% 归入基金财产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

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	1,384,250.53
银行间市场交易费用	-
合计	1,384,250.53

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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

银行划款手续费	3,958.23
其他	360.00
合计	91,098.68

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、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	13,922,295.58	1.54	1,000,701.50	0.07

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	12,964.36	1.54	12,964.36	2.68
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	931.93	0.07	931.93	0.17

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	1,063,408.26	1,897,392.32
其中：支付销售机构的客户维护费	380,865.84	870,914.28

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 1.50%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

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1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	177,234.72	316,232.09

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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于本报告期及上年度可比期间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
中国建设银行-活期	15,325,513.89	19,443.51	12,235,754.75	67,637.37

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

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
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股流通受限	24.60	163.00	177	4,354.20	28,851.00	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	271	6,690.99	8,593.41	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	21.31	49.94	210	4,475.10	10,487.40	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-

300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	704	4,836.48	8,497.28	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	150	4,242.00	17,356.50	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	33.22	87.50	199	6,610.78	17,412.50	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	48.59	90.39	129	6,268.11	11,660.31	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	174	4,332.60	4,316.94	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股流通受限	14.79	30.57	261	3,860.19	7,978.77	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-

		日	日								
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43		-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	783	3,868.02	10,218.15		-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32		-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62		-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28		-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股流通受限	12.54	27.89	469	5,881.26	13,080.41		-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98		-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00		-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20		-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46		-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50		-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78		-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41		-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39		-
605287	德才	2021年	2021年	新股流	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44		-

	股份	6月28日	7月6日	通受限						
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	1,703	37,397.88	37,397.88	-
688097	博众精工	2021年4月29日	2021年11月12日	新股流通受限	11.27	28.01	3,311	37,314.97	92,741.11	-
688201	信安世纪	2021年4月13日	2021年10月21日	新股流通受限	26.78	45.41	1,642	43,972.76	74,563.22	-
688216	气派科技	2021年6月15日	2021年12月23日	新股流通受限	14.82	47.64	2,000	29,640.00	95,280.00	-
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	-
688269	凯立新材	2021年6月1日	2021年12月9日	新股流通受限	18.94	100.92	1,843	34,906.42	185,995.56	-
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	1,072	38,967.20	85,202.56	-
688350	富淼科技	2021年1月21日	2021年7月28日	新股流通受限	13.58	22.44	2,450	33,271.00	54,978.00	-
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	1,290	50,116.50	50,116.50	-
688606	奥泰生物	2021年3月17日	2021年9月27日	新股流通受限	133.67	139.31	675	90,227.25	94,034.25	-
688656	浩欧博	2021年1月6日	2021年7月13日	新股流通受限	35.26	72.60	1,069	37,692.94	77,609.40	-
688659	元琛科技	2021年3月24日	2021年9月30日	新股流通受限	6.50	10.46	3,671	23,861.50	38,398.66	-
688663	新风光	2021年4月6日	2021年10月13日	新股流通受限	14.48	19.21	2,981	43,164.88	57,265.01	-
688686	奥普特	2020年12月24日	2021年7月1日	新股流通受限	78.49	451.00	660	51,803.40	297,660.00	-

688690	纳微科技	2021年6月16日	2021年12月23日	新股流通受限	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	-
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
123116	万兴转债	2021年6月9日	2021年7月1日	新债流通受限	100.00	100.00	570	57,000.00	57,000.00	-

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发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.06%（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的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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 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	15,325,513.89	-	-	-	-	-	15,325,513.89
结算备付金	462,018.55	-	-	-	-	-	462,018.55
存出保证金	25,521.72	-	-	-	-	-	25,521.72
交易性金融资产	-	-	-	-	114,569.20	170,388,188.36	170,502,757.56
应收利息	-	-	-	-	-	1,618.84	1,618.84
应收申购款	-	-	-	-	-	2,552,334.99	2,552,334.99
资产总计	15,813,054.16	-	-	-	114,569.20	172,942,142.19	188,869,765.55
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	622,382.89	622,382.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	197,894.57	197,894.57
应付托管费	-	-	-	-	-	32,982.42	32,982.42
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,300,034.28	1,300,034.28
应付交易费用	-	-	-	-	-	482,883.76	482,883.76
应交税费	-	-	-	-	-	0.59	0.59
其他负债	-	-	-	-	-	87,190.72	87,190.72
负债总计	-	-	-	-	-	2,723,369.23	2,723,369.23
利率敏感度缺口	15,813,054.16	-	-	-	114,569.20	-	-
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	9,728,732.65	-	-	-	-	-	9,728,732.65
结算备付金	550,625.42	-	-	-	-	-	550,625.42
存出保证金	42,642.36	-	-	-	-	-	42,642.36
交易性金融资产	-	-	-	-	-	130,519,259.84	130,519,259.84
应收利息	-	-	-	-	-	1,223.81	1,223.81
应收申购款	-	-	-	-	-	36,479.18	36,479.18

应收证券清算款	-	-	-	-	168,282.69	168,282.69
资产总计	10,322,000.43	-	-	-	130,725,245.52	141,047,245.95
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	884,996.60	884,996.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	180,624.45	180,624.45
应付托管费	-	-	-	-	30,104.07	30,104.07
应付交易费用	-	-	-	-	419,006.12	419,006.12
其他负债	-	-	-	-	175,387.58	175,387.58
负债总计	-	-	-	-	1,690,118.82	1,690,118.82
利率敏感度缺口	10,322,000.43	-	-	-	-	-

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 0.06%（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	170,388,188.36	91.53	130,519,259.84	93.66
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	170,388,188.36	91.53	130,519,259.84	93.66

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%	5,470,844.54	6,946,974.22
	沪深 300 指数下降 5%	-5,470,844.54	-6,946,974.22

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 168,461,421.10 元，属于第二层次的余额为 2,041,336.46 元，无属于第三层次的余额（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 127,454,034.53 元，属于第二层次的余额为 3,065,225.31 元，无属于第三层次的余额）。

(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) 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	170,388,188.36	90.21
	其中：股票	170,388,188.36	90.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	114,569.20	0.06
	其中：债券	114,569.20	0.06
	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	15,787,532.44	8.36
8	其他各项资产	2,579,475.55	1.37
9	合计	188,869,765.55	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,689,327.78	0.91
B	采矿业	3,455,181.00	1.86
C	制造业	116,066,638.06	62.35

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,026,493.39	3.77
E	建筑业	3,416,103.37	1.84
F	批发和零售业	13,228,250.46	7.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,445,890.00	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,501,281.41	5.64
J	金融业	2,023,523.10	1.09
K	房地产业	516,421.00	0.28
L	租赁和商务服务业	2,189,375.00	1.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	808,194.69	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	458,277.00	0.25
Q	卫生和社会工作	2,281,552.85	1.23
R	文化、体育和娱乐业	5,281,679.25	2.84
S	综合	-	-
	合计	170,388,188.36	91.53

7.2.2 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

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	000875	吉电股份	690,900	3,965,766.00	2.13
2	300395	菲利华	73,966	3,566,640.52	1.92
3	603186	华正新材	96,705	3,525,864.30	1.89
4	603599	广信股份	114,300	3,438,144.00	1.85
5	600502	安徽建工	873,900	3,390,732.00	1.82
6	002097	山河智能	368,400	3,160,872.00	1.70
7	603566	普莱柯	137,800	3,141,840.00	1.69
8	603103	横店影视	196,275	2,889,168.00	1.55
9	300327	中颖电子	33,300	2,838,159.00	1.52
10	300639	凯普生物	82,679	2,729,233.79	1.47
11	300458	全志科技	30,500	2,673,630.00	1.44
12	600483	福能股份	251,500	2,638,235.00	1.42
13	603108	润达医疗	229,100	2,572,793.00	1.38
14	603678	火炬电子	38,100	2,571,750.00	1.38
15	601678	滨化股份	318,900	2,522,499.00	1.36

16	603728	鸣志电器	142,400	2,504,816.00	1.35
17	600742	一汽富维	243,800	2,484,322.00	1.33
18	603606	东方电缆	123,100	2,479,234.00	1.33
19	000725	京东方 A	379,800	2,369,952.00	1.27
20	603026	石大胜华	14,500	2,349,725.00	1.26
21	002043	兔宝宝	226,600	2,234,276.00	1.20
22	600057	厦门象屿	350,300	2,189,375.00	1.18
23	600711	盛屯矿业	283,700	2,022,781.00	1.09
24	603337	杰克股份	72,900	1,948,617.00	1.05
25	000026	飞亚达	139,900	1,947,408.00	1.05
26	601928	凤凰传媒	260,400	1,859,256.00	1.00
27	300755	华致酒行	45,500	1,856,855.00	1.00
28	300373	扬杰科技	30,100	1,822,254.00	0.98
29	600966	博汇纸业	135,000	1,761,750.00	0.95
30	300783	三只松鼠	36,100	1,709,696.00	0.92
31	603590	康辰药业	45,900	1,693,251.00	0.91
32	600710	苏美达	273,200	1,688,376.00	0.91
33	300452	山河药辅	113,100	1,687,452.00	0.91
34	603882	金域医学	10,205	1,630,452.85	0.88
35	300448	浩云科技	183,100	1,501,420.00	0.81
36	603612	索通发展	83,400	1,498,698.00	0.81
37	300724	捷佳伟创	12,700	1,473,327.00	0.79
38	002645	华宏科技	91,500	1,462,170.00	0.79
39	300761	立华股份	44,100	1,461,033.00	0.78
40	603985	恒润股份	85,840	1,454,988.00	0.78
41	603267	鸿远电子	10,800	1,381,536.00	0.74
42	300378	鼎捷软件	63,800	1,369,786.00	0.74
43	002641	永高股份	198,000	1,366,200.00	0.73
44	600038	中直股份	25,000	1,318,500.00	0.71
45	601882	海天精工	84,100	1,307,755.00	0.70
46	603416	信捷电气	20,500	1,301,135.00	0.70
47	601636	旗滨集团	69,600	1,291,776.00	0.69
48	300785	值得买	13,528	1,285,160.00	0.69
49	300465	高伟达	105,500	1,280,770.00	0.69
50	601211	国泰君安	73,700	1,263,218.00	0.68
51	000550	江铃汽车	53,905	1,262,994.15	0.68
52	601339	百隆东方	233,000	1,255,870.00	0.67
53	600337	美克家居	291,800	1,228,478.00	0.66
54	600729	重庆百货	44,500	1,221,525.00	0.66
55	300593	新雷能	27,800	1,207,910.00	0.65
56	000810	创维数字	140,000	1,191,400.00	0.64
57	300696	爱乐达	28,380	1,181,175.60	0.63

58	600132	重庆啤酒	5,900	1,167,905.00	0.63
59	603639	海利尔	63,973	1,150,874.27	0.62
60	300659	中孚信息	32,900	1,104,453.00	0.59
61	002042	华孚时尚	218,700	1,056,321.00	0.57
62	300687	赛意信息	47,980	1,025,332.60	0.55
63	600887	伊利股份	27,800	1,023,874.00	0.55
64	600297	广汇汽车	335,300	965,664.00	0.52
65	002531	天顺风能	110,800	958,420.00	0.51
66	002056	横店东磁	72,004	936,052.00	0.50
67	300394	天孚通信	35,840	907,468.80	0.49
68	002408	齐翔腾达	72,800	904,176.00	0.49
69	600782	新钢股份	160,800	897,264.00	0.48
70	600426	华鲁恒升	28,680	887,646.00	0.48
71	300567	精测电子	14,400	884,160.00	0.47
72	603113	金能科技	48,900	883,134.00	0.47
73	603229	奥翔药业	26,340	879,492.60	0.47
74	002254	泰和新材	42,800	867,556.00	0.47
75	000012	南玻A	84,500	865,280.00	0.46
76	300740	水羊股份	41,400	864,432.00	0.46
77	002068	黑猫股份	111,400	845,526.00	0.45
78	300748	金力永磁	26,240	829,971.20	0.45
79	002539	云图控股	94,000	820,620.00	0.44
80	000507	珠海港	133,900	810,095.00	0.44
81	600562	国睿科技	53,500	806,245.00	0.43
82	601827	三峰环境	79,000	748,130.00	0.40
83	002847	盐津铺子	7,500	747,900.00	0.40
84	002139	拓邦股份	40,750	733,092.50	0.39
85	002483	润邦股份	150,500	723,905.00	0.39
86	002048	宁波华翔	36,700	715,650.00	0.38
87	600295	鄂尔多斯	40,000	715,600.00	0.38
88	002182	云海金属	58,700	703,226.00	0.38
89	300451	创业慧康	76,704	678,063.36	0.36
90	002262	恩华药业	43,200	663,120.00	0.36
91	300244	迪安诊断	17,000	651,100.00	0.35
92	601598	中国外运	125,900	635,795.00	0.34
93	000830	鲁西化工	33,800	633,074.00	0.34
94	000921	海信家电	43,500	625,095.00	0.34
95	600884	杉杉股份	26,500	617,980.00	0.33
96	300369	绿盟科技	38,300	610,885.00	0.33
97	300463	迈克生物	14,400	606,096.00	0.33
98	600298	安琪酵母	10,900	592,742.00	0.32
99	600197	伊力特	17,600	539,616.00	0.29

100	603456	九洲药业	11,100	539,238.00	0.29
101	688166	博瑞医药	12,861	537,718.41	0.29
102	603466	风语筑	32,615	533,255.25	0.29
103	603600	永艺股份	50,800	522,224.00	0.28
104	601001	晋控煤业	71,500	519,090.00	0.28
105	300686	智动力	31,500	518,490.00	0.28
106	600409	三友化工	50,400	509,544.00	0.27
107	002726	龙大肉食	49,400	499,928.00	0.27
108	300841	康华生物	1,800	483,840.00	0.26
109	002064	华峰化学	33,600	477,120.00	0.26
110	000656	金科股份	82,100	475,359.00	0.26
111	300138	晨光生物	30,900	472,770.00	0.25
112	000799	酒鬼酒	1,800	460,080.00	0.25
113	000526	学大教育	17,300	458,277.00	0.25
114	000923	河钢资源	23,800	453,866.00	0.24
115	002979	雷赛智能	14,825	425,032.75	0.23
116	603393	新天然气	22,400	409,472.00	0.22
117	002026	山东威达	29,300	400,238.00	0.22
118	002839	张家港行	71,900	391,136.00	0.21
119	300101	振芯科技	21,660	387,930.60	0.21
120	300624	万兴科技	6,500	380,770.00	0.20
121	300121	阳谷华泰	30,700	377,917.00	0.20
122	002701	奥瑞金	71,800	369,052.00	0.20
123	002030	达安基因	17,140	364,053.60	0.20
124	300766	每日互动	23,400	350,766.00	0.19
125	300010	豆神教育	56,100	318,087.00	0.17
126	300415	伊之密	14,600	313,900.00	0.17
127	000049	德赛电池	6,800	312,120.00	0.17
128	603118	共进股份	33,000	304,590.00	0.16
129	601666	平煤股份	42,500	302,175.00	0.16
130	002603	以岭药业	10,300	300,348.00	0.16
131	600201	生物股份	17,200	300,140.00	0.16
132	688686	奥普特	660	297,660.00	0.16
133	300726	宏达电子	4,100	289,009.00	0.16
134	002332	仙琚制药	22,500	282,150.00	0.15
135	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.15
136	688116	天奈科技	2,295	270,810.00	0.15
137	300406	九强生物	13,700	270,301.00	0.15
138	600419	天润乳业	20,400	266,424.00	0.14
139	002382	蓝帆医疗	12,600	262,710.00	0.14
140	601375	中原证券	53,600	261,032.00	0.14
141	002171	楚江新材	29,800	260,154.00	0.14

142	300773	拉卡拉	8,500	239,955.00	0.13
143	002234	民和股份	14,800	222,444.00	0.12
144	300145	中金环境	72,900	221,616.00	0.12
145	603809	豪能股份	16,700	220,774.00	0.12
146	002518	科士达	15,300	219,861.00	0.12
147	600997	开滦股份	28,900	216,750.00	0.12
148	002987	京北方	6,600	210,870.00	0.11
149	000898	鞍钢股份	46,100	205,145.00	0.11
150	002960	青鸟消防	7,700	201,432.00	0.11
151	603348	文灿股份	5,700	199,500.00	0.11
152	688269	凯立新材	1,843	185,995.56	0.10
153	002237	恒邦股份	15,600	179,244.00	0.10
154	300083	创世纪	15,500	169,725.00	0.09
155	000825	太钢不锈	20,700	155,043.00	0.08
156	002179	中航光电	1,900	150,138.00	0.08
157	603727	博迈科	8,200	149,404.00	0.08
158	600867	通化东宝	12,300	146,862.00	0.08
159	688308	欧科亿	1,843	124,900.11	0.07
160	300791	仙乐健康	1,950	108,030.00	0.06
161	688288	鸿泉物联	2,200	104,698.00	0.06
162	688216	气派科技	2,000	95,280.00	0.05
163	688606	奥泰生物	675	94,034.25	0.05
164	688097	博众精工	3,311	92,741.11	0.05
165	688276	百克生物	1,072	85,202.56	0.05
166	688656	浩欧博	1,069	77,609.40	0.04
167	688201	信安世纪	1,642	74,563.22	0.04
168	601377	兴业证券	7,600	73,416.00	0.04
169	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.03
170	002946	新乳业	3,900	59,085.00	0.03
171	688663	新风光	2,981	57,265.01	0.03
172	688350	富淼科技	2,450	54,978.00	0.03
173	300920	润阳科技	1,626	54,763.68	0.03
174	688499	利元亨	1,290	50,116.50	0.03
175	000528	柳工	5,800	47,560.00	0.03
176	688388	嘉元科技	500	45,480.00	0.02
177	300642	透景生命	500	42,905.00	0.02
178	688679	通源环境	3,139	41,372.02	0.02
179	002244	滨江集团	9,800	41,062.00	0.02
180	300073	当升科技	700	39,333.00	0.02
181	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.02
182	300299	富春股份	6,500	37,505.00	0.02
183	688087	英科再生	1,703	37,397.88	0.02

184	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
185	300919	中伟股份	177	28,851.00	0.02
186	002206	海利得	4,100	25,461.00	0.01
187	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
188	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
189	300979	华利集团	199	17,412.50	0.01
190	300973	立高食品	150	17,356.50	0.01
191	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
192	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
193	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
194	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
195	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
196	301009	可靠股份	469	13,080.41	0.01
197	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
198	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
199	300981	中红医疗	129	11,660.31	0.01
200	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01
201	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
202	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
203	300941	创识科技	210	10,487.40	0.01
204	300997	欢乐家	783	10,218.15	0.01
205	300996	普联软件	241	10,177.43	0.01
206	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01
207	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
208	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
209	300932	三友联众	271	8,593.41	0.00
210	300968	格林精密	704	8,497.28	0.00
211	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
212	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
213	300986	志特新材	261	7,978.77	0.00
214	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
215	601898	中煤能源	1,100	7,865.00	0.00
216	002833	弘亚数控	200	7,750.00	0.00
217	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
218	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
219	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
220	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
221	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
222	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
223	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
224	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
225	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00

226	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
227	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
228	300985	致远新能	174	4,316.94	0.00
229	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
230	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
231	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
232	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	603186	华正新材	5,475,924.12	3.93
2	300395	菲利华	4,544,889.32	3.26
3	000725	京东方 A	4,508,539.00	3.24
4	600502	安徽建工	3,961,482.00	2.84
5	600063	皖维高新	3,639,785.00	2.61
6	000875	吉电股份	3,519,095.00	2.53
7	600483	福能股份	3,452,490.00	2.48
8	603599	广信股份	3,442,502.00	2.47
9	300659	中孚信息	3,310,230.00	2.38
10	002097	山河智能	3,188,253.00	2.29
11	603103	横店影视	3,153,221.17	2.26
12	603678	火炬电子	3,149,221.00	2.26
13	603606	东方电缆	3,141,816.77	2.25
14	603728	鸣志电器	3,118,852.00	2.24
15	601928	凤凰传媒	3,048,168.00	2.19
16	603882	金域医学	3,046,919.00	2.19
17	000026	飞亚达	3,039,163.00	2.18
18	300755	华致酒行	3,023,722.20	2.17
19	300101	振芯科技	3,014,550.00	2.16
20	600966	博汇纸业	3,006,347.00	2.16
21	603566	普莱柯	2,924,326.00	2.10
22	000550	江铃汽车	2,897,982.05	2.08
23	300624	万兴科技	2,859,741.60	2.05
24	002020	京新药业	2,853,851.00	2.05
25	600742	一汽富维	2,850,650.00	2.05
26	600096	云天化	2,830,972.00	2.03
27	600348	华阳股份	2,830,344.00	2.03
28	601212	白银有色	2,819,635.00	2.02
29	002043	兔宝宝	2,812,637.00	2.02
30	002483	润邦股份	2,796,966.00	2.01

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	600096	云天化	4,938,135.00	3.54
2	300101	振芯科技	4,454,034.00	3.20
3	300119	瑞普生物	3,964,002.00	2.84
4	000600	建投能源	3,939,460.00	2.83
5	603882	金域医学	3,935,867.56	2.82
6	002726	龙大肉食	3,575,067.60	2.57
7	600461	洪城环境	3,546,421.00	2.54
8	600063	皖维高新	3,468,823.00	2.49
9	002056	横店东磁	3,414,849.00	2.45
10	002539	云图控股	3,381,330.00	2.43
11	603886	元祖股份	3,323,670.00	2.39
12	601222	林洋能源	3,310,771.28	2.38
13	603686	龙马环卫	3,258,342.00	2.34
14	601699	潞安环能	3,247,163.00	2.33
15	300624	万兴科技	3,179,905.72	2.28
16	002139	拓邦股份	3,077,032.00	2.21
17	002020	京新药业	3,069,758.00	2.20
18	300740	水羊股份	3,021,244.37	2.17
19	603871	嘉友国际	3,003,498.72	2.16
20	600507	方大特钢	2,998,248.00	2.15
21	600348	华阳股份	2,831,615.00	2.03
22	603238	诺邦股份	2,829,152.72	2.03
23	603612	索通发展	2,789,023.00	2.00

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	461,907,867.50
卖出股票收入（成交）总额	448,243,504.21

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）	114,569.20	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	114,569.20	0.06

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	123105	拓尔转债	520	57,569.20	0.03
2	123116	万兴转债	570	57,000.00	0.03

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、国债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、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

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

本基金可投资股指期货、国债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、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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**

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

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	25,521.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,618.84
5	应收申购款	2,552,334.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,579,475.55

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 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**

份额单位：份

持有人户数	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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 (%)
15,557	7,301.03	62,810.84	0.06	113,519,308.18	99.94

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	107,522.94	0.094665

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 (2018 年 2 月 6 日) 基金份额总额	1,784,551,427.10
本报告期期初基金份额总额	100,162,131.71
本报告期基金总申购份额	68,396,463.25
减：本报告期基金总赎回份额	54,976,475.94
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	113,582,119.02

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 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	
光大证券股份有限公司	2	225,855,796.47	24.95%	210,340.34	24.95%	-
西部证券股份有限公司	2	124,450,961.16	13.75%	115,900.90	13.75%	-
东北证券股份有限公司	1	94,061,668.82	10.39%	87,599.19	10.39%	-
广发证券股份有限公司	1	85,508,697.31	9.45%	79,634.41	9.45%	-
中泰证券股份有限公司	2	72,324,066.09	7.99%	67,356.83	7.99%	-
东方财富证券股份有限公司	2	51,325,268.41	5.67%	47,797.65	5.67%	-

长江证券股 份有限公司	1	48,079,203.29	5.31%	44,776.49	5.31%	-
国信证券股 份有限公司	2	43,299,498.38	4.78%	40,323.94	4.78%	-
中银国际证 券股份有限 公司	1	34,212,884.40	3.78%	31,862.99	3.78%	-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	32,190,105.62	3.56%	29,978.88	3.56%	-
天风证券股 份有限公司	1	25,879,347.19	2.86%	24,101.33	2.86%	-
华创证券有 限责任公司	1	22,861,806.25	2.53%	21,290.52	2.53%	-
东方证券股 份有限公司	1	16,976,828.66	1.88%	15,810.61	1.88%	-
长城证券股 份有限公司	2	13,922,295.58	1.54%	12,964.36	1.54%	-
汇丰前海证 券有限责任 公司	1	5,057,016.82	0.56%	4,709.65	0.56%	-
方正证券股 份有限公司	1	3,780,412.02	0.42%	3,520.77	0.42%	-
中信建投证 券股份有限 公司	2	2,830,779.36	0.31%	2,636.37	0.31%	-
渤海证券股 份有限公司	1	1,993,321.43	0.22%	1,856.50	0.22%	本期 退租 1 个

中信证券股 份有限公司	3	603,379.00	0.07%	561.93	0.07%	-
中国国际金 融股份有限 公司	1	30,955.63	0.00%	28.82	0.00%	-
安信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

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
光大证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-

西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	206,225.00	100.00%	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
中信建投证券股份有限公司						
渤海证券股份有限公司						
中信证券股份有限公司						
中国国际金融股份有限公司						
安信证券股份有限公司						
招商证券股份有限公司						

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
3	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
4	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
5	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
6	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 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系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-05
8	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
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	2021-02-25

10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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
16	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
17	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
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	2021-04-02
19	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
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	2021-04-15
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	2021-04-19
22	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
23	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
24	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
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	2021-04-23
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	2021-05-12
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	2021-05-20
28	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2021 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-28
29	景顺长城量化小盘股票型证券投资基	中国证监会指定报刊及	2021-05-28

	金基金产品资料概要更新	网站	
30	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
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	2021-06-15
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	2021-06-18
33	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2021 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
34	景顺长城量化小盘股票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
35	景顺长城量化小盘股票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

§ 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量化小盘股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

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