

# 景顺长城品质长青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：招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。

基金托管人招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 02 月 09 日（基金合同生效日）起至 2021 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45

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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.12 投资组合报告附注 .....	46
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8 其他重大事件 .....	50
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</b>
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 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城品质长青混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城品质长青混合
基金主代码	010350
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 9 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,134,759,597.23 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，自下而上的挖掘高品质公司的投资机会，积极选择具备良好竞争优势以及持续成长潜力的股票。追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要包括：</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金基于定量、定性分析相结合的宏观经济与市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。本基金主要考虑的因素为：（1）宏观经济指标，包括 GDP 增速、工业增加值增速、PPI、CPI、市场利率变化、社会融资总额、固定资产投资、进出口贸易、人民币汇率等因素；（2）市场方面指标，包括市场整体估值水平、海外市场对标行业估值水平与市值等；（3）政策因素，包括货币政策与财政政策，以及涉及资本市场改革等方面政策等。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过深入研究、甄选卓越且基业长青的优秀企业进行投资。一般而言，此类企业具有以下特征：企业具备高盈利能力、高盈利质量、卓越的市场地位、积极回报股东等；企业的价值观是追求卓越而基业长青的，即便经营上遇到波折挑战，也会考虑长远，最终实现螺旋式的发展。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以</p>

	<p>及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。</p> <p>6、股票期权投资策略</p> <p>本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p>7、国债期货投资策略</p> <p>本基金可投资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。</p> <p>8、参与融资业务的投资策略</p> <p>本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，对冲系统性风险，实现保值和锁定收益。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证港股通综合指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中证综合债券指数×20%
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金还可投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	张燕
	联系电话	0755-82370388	0755-83199084
	电子邮箱	investor@igwfm.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008888606	95555
传真		0755-22381339	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		李进	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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2月9日(基金合同生效日) - 2021年6月30日)
本期已实现收益	141,229,986.15
本期利润	255,692,486.90
加权平均基金份额本期利润	0.0898
本期加权平均净值利润率	8.97%
本期基金份额净值增长率	8.78%
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	128,191,062.38
期末可供分配基金份额利润	0.0600
期末基金资产净值	2,322,208,752.28
期末基金份额净值	1.0878
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	8.78%

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。

5、本基金基金合同生效日为2021年2月9日。

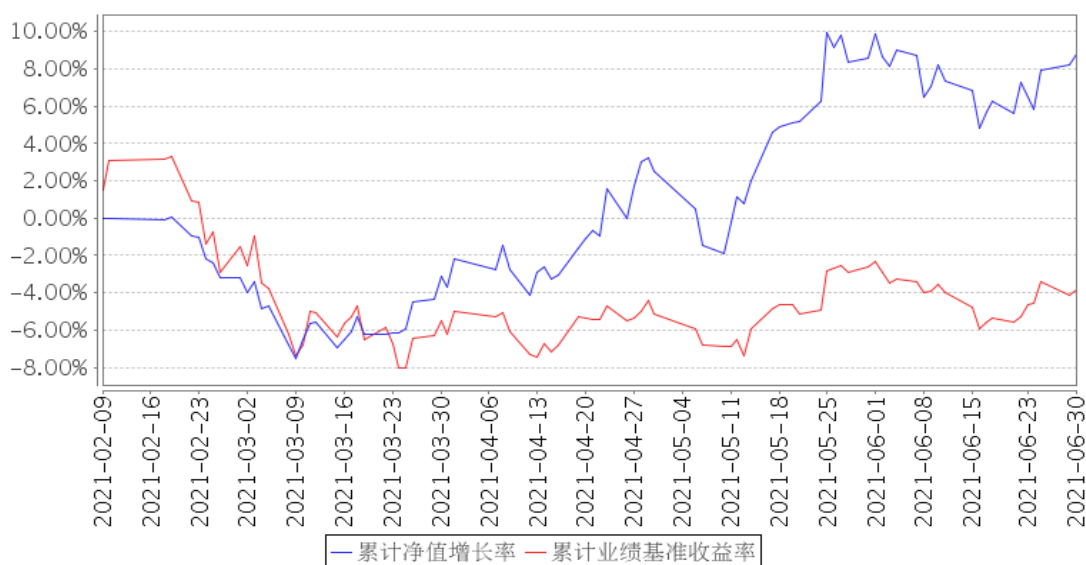
## 3.2 基金净值表现

### 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	0.22%	1.10%	-1.25%	0.60%	1.47%	0.50%
过去三个月	12.98%	1.24%	2.51%	0.73%	10.47%	0.51%
自基金合同生效起至今	8.78%	1.12%	-3.84%	1.01%	12.62%	0.11%

### 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

景顺长城品质长青混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的保证金以后，应当保持现金或者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、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自 2021 年 2 月 9 日基金合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2021 年 2 月 9 日）起至本报告期末不满一年。



### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截至2021年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理124只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金（QDII）、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城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		
江科宏	本基金的基金经理	2021 年 2 月 9 日	-	14 年	经济学硕士，CFA。2007 年至 2010 年曾任本公司总经理办公室风险管理经理。2011 年 2 月重新加入本公司，担任研究部研究员，自 2012 年 6 月起历任股票投资部基金经理、量化及 ETF 投资部基金经理，现任股票投资部基金经理。具有 14 年证券、基金行业从业经验。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城品质长青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。

#### 4.3 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 年上半年市场宽幅震荡，春节前上扬，节后大幅回调，二季度又风格切换；总体看，沪深 300 指数上涨 0.24%，创业板指数上涨 17.22%，新能源、科技、医药等股票表现优异，而消费、金融等股票整体表现不佳。市场突出的风格偏好并未动摇我们对优质公司的信心，长期看，真正具备竞争力、高质量公司的长期收益率是能够战胜市场指数的。本基金在市场高位成立，在一季度市场的剧烈调整中，采取逐步建仓的策略，稳健的投资于消费、医药、周期制造等竞争优势持续扩张的公司，并将市场的调整视作一次良好的长期投资机会。本基金自成立以来净值表现稳健。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至本报告期期末，本基金份额净值增长率为 8.78%，业

绩比较基准收益率为-3.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

疫情对经济的短期冲击逐步减弱，优秀公司在面对挑战、应对疫情的过程中，进一步扩大了竞争优势，为疫情后的发展奠定了坚实基础，增强了我们长期投资于高质量公司的信心。我们预计经济在积极财政政策支持下会逐步复苏，但面临的内外部压力依然很大；长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在产业升级的背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。

流动性整体趋向正常，组合估值很难进一步扩张，组合将继续维持均衡配置。我们会继续保持自下而上的选股风格，根据公司竞争优势、行业集中度、长期成长和估值等因素调整组合，在更多行业中寻找竞争壁垒持续增强的公司，寻找能够低成本扩张和具备品牌溢价的公司，更加注重公司质地，相信高质量公司能够穿越周期，为长期投资人带来超额回报。行业配置方面主要看好消费、周期制造、医药等长期受益于产业创新和消费升级的行业。

优秀的企业是人类智慧的结晶，只有企业创造的价值才是股票投资获利的根本来源；本基金将继续专注于做高质量优质公司的超长期股东，凭借深度研究，将投资收益深植于企业的基业长青和组合的风险管理之上。我们将继续在自身能力圈范围以内，严格执行投资流程，维持稳定的投资风格，在更多行业中自下而上的挑选资本回报率高、竞争优势持续扩张的高质量公司，分散持股，长期投资，力争通过分享企业价值来获取良好的长期投资回报。

#### 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适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估

值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：景顺长城品质长青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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	321,739,104.95
结算备付金		631,712.97
存出保证金		823,146.10
交易性金融资产	6.4.7.2	2,049,748,803.68
其中：股票投资		2,049,748,803.68
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		7,233,993.59
应收利息	6.4.7.5	22,030.66
应收股利		-
应收申购款		692,801.51
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		2,380,891,593.46
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>
<b>负债：</b>		
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		6,919,819.38
应付赎回款		46,188,620.77
应付管理人报酬		2,978,409.89
应付托管费		496,401.65
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	1,884,596.86
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	214,992.63
负债合计		58,682,841.18
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	2,134,759,597.23

未分配利润	6.4.7.10	187,449,155.05
所有者权益合计		2,322,208,752.28
负债和所有者权益总计		2,380,891,593.46

注：1. 报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0878 元，基金份额总额 2,134,759,597.23 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城品质长青混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		280,611,278.54
1. 利息收入		5,180,992.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,794,484.55
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		3,386,507.56
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		158,279,933.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	149,253,715.50
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	9,026,218.14
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	114,462,500.75
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	2,687,852.04
减：二、费用		24,918,791.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	16,603,279.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,767,213.33
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	5,428,483.43
5. 利息支出		-



其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.19	119,814.98
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		255,692,486.90
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		255,692,486.90

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城品质长青混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）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)	3,062,054,819.55	-	3,062,054,819.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	255,692,486.90	255,692,486.90
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)	-927,295,222.32	-68,243,331.85	-995,538,554.17
其中：1. 基金申购款	59,990,734.54	4,083,134.67	64,073,869.21
2. 基金赎回款	-987,285,956.86	-72,326,466.52	-1,059,612,423.38
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)	2,134,759,597.23	187,449,155.05	2,322,208,752.28

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

景顺长城品质长青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[2020]2315号《关于准予景顺长城品质长青混合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《景顺长城品质长青混合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3,061,833,317.53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(2021)第0133号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城品质长青混合型证券投资基金基金合同》于2021年2月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,062,054,819.55份基金份额,其中认购资金利息折合221,502.02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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城品质长青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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票(包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含可分离交易可转换债券的纯债部分)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金可以根据法律法规的规定参与融资业务。本基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产占基金资产的比例为60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%)。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的保证金以后,应当保持现金或者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、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中证港股通综合指数收益率(使用估值汇率折算)×20%+中证综合债券指数×20%。

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》、《景顺长城品质长青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 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间的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 2 月 9 日(基金合同生效日)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 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金

融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行

调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券投资在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关

于发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **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[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[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]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。

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。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	321,739,104.95



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	321,739,104.95

#### 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	1,935,286,302.93	2,049,748,803.68	114,462,500.75
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	1,935,286,302.93	2,049,748,803.68	114,462,500.75

#### 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	19,592.26
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	2,071.02

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	367.38
合计	22,030.66

#### 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	1,884,596.86
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,884,596.86

#### 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	114,665.35
应付证券出借违约金	-
预提费用	100,327.28
合计	214,992.63

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,062,054,819.55	3,062,054,819.55
本期申购	59,990,734.54	59,990,734.54
本期赎回（以“-”号填列）	-987,285,956.86	-987,285,956.86
- 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	2,134,759,597.23	2,134,759,597.23

注：1. 申购含基金转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2021 年 2 月 3 日至 2021 年 2 月 5 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人

人民币 3,061,833,317.53 元，折合为 3,061,833,317.53 份基金份额。根据《景顺长城品质长青混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 221,502.02 元，折合为 221,502.02 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《景顺长城品质长青混合型证券投资基金基金合同》、《景顺长城品质长青混合型证券投资基金招募说明书》及《景顺长城品质长青混合型证券投资基金关于开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 5 月 5 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回、转换及定期定额投资业务自 2021 年 5 月 6 日起开始办理。

#### 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	141,229,986.15	114,462,500.75	255,692,486.90
本期基金份额交易产生的变动数	-13,038,923.77	-55,204,408.08	-68,243,331.85
其中：基金申购款	946,856.25	3,136,278.42	4,083,134.67
基金赎回款	-13,985,780.02	-58,340,686.50	-72,326,466.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	128,191,062.38	59,258,092.67	187,449,155.05

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	818,958.34
定期存款利息收入	836,111.11
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	133,898.01
其他	5,517.09
合计	1,794,484.55

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,035,594,601.98
减：卖出股票成本总额	886,340,886.48
买卖股票差价收入	149,253,715.50

**6.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**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2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,026,218.14
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	9,026,218.14

**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2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	114,462,500.75
股票投资	114,462,500.75
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	114,462,500.75

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
基金赎回费收入	2,683,803.15
基金转换费收入	4,048.89
合计	2,687,852.04

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 50% 归入基金资产。

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 50%

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2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
交易所市场交易费用	5,428,483.43
银行间市场交易费用	-
合计	5,428,483.43

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	47,913.64
信息披露费	47,913.64
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	6,000.00
银行划款手续费	17,587.70
其他	400.00
合计	119,814.98

#### 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应付关联方佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,603,279.90
其中：支付销售机构的客户维护费	8,022,612.12

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×1.50%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,767,213.33

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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×0.25%/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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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末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2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期	321,739,104.95	818,958.34

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本基金本报告期末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	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
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	1,162	7,982.94	14,025.34	-
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	360	10,180.80	41,655.60	-
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	925	30,728.50	80,937.50	-
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	601	29,202.59	54,324.39	-
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	295	7,345.50	7,318.95	-



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	264	3,904.56	8,070.48	-
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	-
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	928	4,584.32	12,110.40	-
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	801	10,044.54	22,339.89	-
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	2021年7月7日	新股流通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
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	-
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	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688067	爱威科技	2021年6月7日	2021年12月16日	新股流通受限	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
688087	英科再生	2021年6月	2021年7月	新股流	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-

		月 30 日	月 9 日	通受限						
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	-
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	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688538	和辉光电	2021 年 5 月 20 日	2021 年 11 月 29 日	新股流通受限	2.65	3.38	375,156	994,163.40	1,268,027.28	-
688616	西力科技	2021 年 3 月 10 日	2021 年 9 月 22 日	新股流通受限	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04	-

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

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本期末，本基金未持有除国债、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。

#### 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	321,739,104.95	-	-	-	-	-	321,739,104.95
结算备付金	631,712.97	-	-	-	-	-	631,712.97
存出保证金	823,146.10	-	-	-	-	-	823,146.10
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,049,748,803.68	2,049,748,803.68
应收利息	-	-	-	-	-	22,030.66	22,030.66
应收申购款	-	-	-	-	-	692,801.51	692,801.51
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,233,993.59	7,233,993.59
资产总计	323,193,964.02	-	-	-	-	2,057,697,629.44	2,380,891,593.46
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	46,188,620.77	46,188,620.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,978,409.89	2,978,409.89
应付托管费	-	-	-	-	-	496,401.65	496,401.65
应付证券清算款	-	-	-	-	-	6,919,819.38	6,919,819.38
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,884,596.86	1,884,596.86
其他负债	-	-	-	-	-	214,992.63	214,992.63
负债总计	-	-	-	-	-	58,682,841.18	58,682,841.18
利率敏感度缺口	323,193,964.02	-	-	-	-	-	-

##### 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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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				
交易性金融资产	-	455,356,048.60	-	455,356,048.60
资产合计	-	455,356,048.60	-	455,356,048.60
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	455,356,048.60	-	455,356,048.60

#### 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）
分析	所有外币均相对人民币升值 5%	22,767,802.43
	所有外币均相对人民币贬值 5%	-22,767,802.43

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,049,748,803.68	88.27
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	2,049,748,803.68	88.27

#### 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)
分析	沪深 300 指数上升 5%	115,107,442.58
	沪深 300 指数下降 5%	-115,107,442.58

#### 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 2,047,463,923.08 元，属于第二层次的余额为 2,284,880.60 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。

(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	2,049,748,803.68	86.09
	其中:股票	2,049,748,803.68	86.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	322,370,817.92	13.54
8	其他各项资产	8,771,971.86	0.37
9	合计	2,380,891,593.46	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 455,356,048.60 元,占基金资产净值的比例为 19.61%。

### 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	2,304,846.78	0.10
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,252,469,660.67	53.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	257,526.54	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,521,507.83	0.11
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	30,550,180.00	1.32
M	科学研究和技术服务业	49,795,620.00	2.14
N	水利、环境和公共设施管理业	30,146.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	256,390,153.80	11.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,594,392,755.08	68.66

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
周期性消费品	238,178,908.35	10.26
非周期性消费品	-	-
综合	-	-
能源	-	-
金融	71,587,603.40	3.08
工业	70,123,874.83	3.02
信息科技	-	-
公用事业	-	-
通讯	75,465,662.02	3.25
合计	455,356,048.60	19.61

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

### 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	000858	五 粮 液	426,282	126,985,144.98	5.47
2	603899	晨光文具	1,480,695	125,207,569.20	5.39
3	300760	迈瑞医疗	257,171	123,454,938.55	5.32
4	002311	海大集团	1,510,440	123,251,904.00	5.31
5	603288	海天味业	930,669	120,009,767.55	5.17
6	600519	贵州茅台	58,284	119,872,702.80	5.16
7	02313	申洲国际	730,400	119,180,016.60	5.13
8	02020	安踏体育	782,351	118,998,891.75	5.12
9	600276	恒瑞医药	1,673,647	113,757,786.59	4.90
10	000568	泸州老窖	469,317	110,730,652.98	4.77
11	000596	古井贡酒	381,104	91,274,408.00	3.93
12	600809	山西汾酒	198,384	88,876,032.00	3.83
13	603882	金域医学	527,830	84,331,399.10	3.63
14	00700	腾讯控股	155,300	75,465,662.02	3.25
15	00388	香港交易所	185,900	71,587,603.40	3.08
16	00669	创科实业	621,500	70,123,874.83	3.02
17	600763	通策医疗	167,299	68,759,889.00	2.96
18	300015	爱尔眼科	859,465	61,004,825.70	2.63
19	603259	药明康德	318,000	49,795,620.00	2.14
20	600887	伊利股份	1,295,600	47,716,948.00	2.05
21	300347	泰格医药	218,800	42,294,040.00	1.82
22	000333	美的集团	560,800	40,024,296.00	1.72
23	601888	中国中免	101,800	30,550,180.00	1.32
24	600298	安琪酵母	129,300	7,031,334.00	0.30
25	600570	恒生电子	26,800	2,499,100.00	0.11
26	600031	三一重工	83,500	2,427,345.00	0.10
27	600486	扬农化工	21,300	2,380,701.00	0.10
28	600309	万华化学	21,700	2,361,394.00	0.10
29	601100	恒立液压	27,000	2,319,840.00	0.10
30	002714	牧原股份	37,800	2,298,996.00	0.10
31	300957	贝泰妮	8,523	2,298,784.18	0.10
32	688538	和辉光电	375,156	1,268,027.28	0.05
33	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.01
34	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.01
35	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
36	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
37	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
38	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
39	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.00
40	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
41	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
42	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.00

43	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
44	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
45	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
46	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
47	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
48	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
49	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
50	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
51	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
52	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
53	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
54	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
55	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
56	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
57	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
58	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
59	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
60	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
61	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
62	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
63	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
64	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
65	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
66	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
67	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
68	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
69	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
70	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
71	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
72	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
73	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
74	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
75	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
76	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
77	301010	晶雪节能	272	5,127.96	0.00
78	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
79	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
80	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
81	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600276	恒瑞医药	181,379,693.09	7.81
2	600519	贵州茅台	176,410,410.36	7.60
3	603288	海天味业	171,750,676.30	7.40
4	000858	五粮液	171,175,325.79	7.37
5	000568	泸州老窖	169,606,615.27	7.30
6	300015	爱尔眼科	167,122,518.86	7.20
7	600763	通策医疗	154,008,586.79	6.63
8	002311	海大集团	150,028,269.43	6.46
9	02313	申洲国际	147,641,702.84	6.36
10	603899	晨光文具	147,574,979.47	6.35
11	300760	迈瑞医疗	144,125,772.46	6.21
12	02020	安踏体育	142,116,121.64	6.12
13	603259	药明康德	111,148,248.85	4.79
14	603882	金域医学	100,691,445.72	4.34
15	00669	创科实业	97,572,178.70	4.20
16	000596	古井贡酒	96,846,045.35	4.17
17	600809	山西汾酒	95,791,683.24	4.13
18	00700	腾讯控股	90,673,285.98	3.90
19	00388	香港交易所	80,532,606.60	3.47
20	000333	美的集团	67,559,817.15	2.91
21	600887	伊利股份	66,656,013.95	2.87

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300015	爱尔眼科	156,423,771.41	6.74
2	600763	通策医疗	146,836,867.09	6.32
3	603259	药明康德	96,667,549.85	4.16
4	02020	安踏体育	64,700,537.03	2.79
5	000568	泸州老窖	52,902,979.18	2.28
6	02313	申洲国际	51,713,692.74	2.23
7	000858	五粮液	48,472,848.00	2.09
8	603288	海天味业	47,760,110.30	2.06
9	600519	贵州茅台	46,057,228.09	1.98
10	300760	迈瑞医疗	45,280,061.42	1.95
11	600276	恒瑞医药	43,251,642.66	1.86
12	002311	海大集团	39,215,748.42	1.69

13	603882	金域医学	35,355,599.38	1.52
14	600809	山西汾酒	33,194,335.16	1.43
15	603899	晨光文具	29,310,403.44	1.26
16	00669	创科实业	26,912,291.97	1.16
17	000333	美的集团	16,643,143.02	0.72
18	000596	古井贡酒	12,201,216.42	0.53
19	600887	伊利股份	10,049,568.00	0.43
20	00700	腾讯控股	9,982,511.72	0.43

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	2,821,627,189.41
卖出股票收入（成交）总额	1,035,594,601.98

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

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

本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

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

2、套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比

例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

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

## 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

1、江苏恒瑞医药股份有限公司（以下简称“恒瑞医药”，股票代码：600276）因以非本公司发生的机票等报销专家讲课费、点评费、主持费等违法违规行为，违反了《中华人民共和国会计法》第四十二条规定。财政部于 2021 年 4 月 12 日发布《中华人民共和国财政部会计信息质量检查公告》（第四十号），对恒瑞医药处以 5 万元的罚款。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对恒瑞医药进行了投资。

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。

### 7.12.2 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	823,146.10
2	应收证券清算款	7,233,993.59
3	应收股利	-
4	应收利息	22,030.66

5	应收申购款	692,801.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,771,971.86

#### 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)	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 (%)
33,824	63,113.75	9,314,584.14	0.44	2,125,445,013.09	99.56

### 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	1,016,992.01	0.047640

### 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

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2021 年 2 月 9 日) 基 金份额总额	3,062,054,819.55
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	59,990,734.54
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	987,285,956.86

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,134,759,597.23

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----



	单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券股份有限公司	1	1,165,581,841.66	30.27%	1,023,269.16	29.83%	-
华泰证券股份有限公司	2	656,564,658.38	17.05%	611,455.62	17.83%	-
中国银河证券股份有限公司	1	526,447,039.35	13.67%	490,281.57	14.29%	-
中信建投证券股份有限公司	2	458,865,373.10	11.92%	406,828.08	11.86%	-
中信证券股份有限公司	2	333,187,945.90	8.65%	245,575.01	7.16%	-
华安证券股份有限公司	1	261,597,994.60	6.79%	241,859.88	7.05%	-
摩根大通证券(中国)有限公司	1	234,059,391.76	6.08%	217,979.66	6.36%	-
财通证券股份有限公司	1	142,064,698.22	3.69%	132,305.28	3.86%	-
平安证券股份有限公司	2	50,396,761.27	1.31%	41,584.97	1.21%	-
方正证券股份有限公司	2	21,247,788.27	0.55%	18,837.00	0.55%	-
华兴证券有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金与景顺长城量化平衡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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	4,230,200,000.00	56.03%	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	1,194,100,000.00	15.82%	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	2,125,200,000.00	28.15%	-	-
华安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券(中国)有限公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华兴证券有限公司	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-08
2	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
3	景顺长城品质长青混合型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-22
4	景顺长城品质长青混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-22
5	景顺长城品质长青混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-22
6	景顺长城品质长青混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-22
7	景顺长城品质长青混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-22
8	景顺长城品质长青混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-22
9	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城品质长青混合型证券投资基金不开通直销网上交易系统“赎回转认购”业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-29
10	景顺长城品质长青混合型证券投资基金新增中国银行等多家公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-02

11	景顺长城品质长青混合型证券投资基金新增交通银行等多家公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-03
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	2021-02-05
13	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
14	关于景顺长城品质长青混合型证券投资基金基金合同生效的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-10
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	2021-02-25
16	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
17	景顺长城基金管理有限公司关于修订旗下景顺长城品质长青混合型证券投资基金基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
18	景顺长城品质长青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	2021-03-12
19	景顺长城品质长青混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
20	景顺长城品质长青混合型证券投资基金基金合同（基金合同更新）	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
21	景顺长城品质长青混合型证券投资基金托管协议（托管协议更新）	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
22	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-20
23	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
24	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
25	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
26	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
27	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
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	2021-04-15
29	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-19

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	2021-04-20
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	2021-04-23
32	关于景顺长城品质长青混合型证券投资基金参加部分销售机构申购及/或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	2021-04-28
33	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城品质长青混合型证券投资基金在直销网上交易系统开展申购、定投和转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-28
34	景顺长城品质长青混合型证券投资基金关于开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-28
35	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
36	关于景顺长城品质长青混合型证券投资基金 2021 年主要投资市场节假日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回及转换业务安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-17
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	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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品质长青混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城品质长青混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《景顺长城品质长青混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城品质长青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