

景顺长城中小创精选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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	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	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40

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	41
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	41
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	41
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	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	43
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中小创精选股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城中小创精选股票
基金主代码	000586
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 4 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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	123,976,338.93 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选符合中小创主题且具备高成长特性的股票，充分把握经济结构转型格局下新兴行业高增长带来的收益，在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>1、资产配置:本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>2、股票投资策略: 本基金股票投资主要遵循“自下而上”的个股投资策略，利用基金管理人股票研究数据库（SRD）对企业内在价值进行深入细致的分析，通过景顺长城“股票研究数据库（SRD）”中的标准分析模板对中小创主题的上市公司的基本面和估值水平进行鉴别，制定股票买入名单。</p> <p>3、债券投资策略: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>
业绩比较基准	创业板综合指数×45%+中小企业综合指数×45%+中证全债指数×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中风险程度较高的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95599
传真	0755-22381339	010-68121816
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里	北京市东城区建国门内大街 69

	建设广场第一座 21 层	号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518048	100031
法定代表人	李进	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	59,013,510.09
本期利润	13,801,135.29
加权平均基金份额本期利润	0.0949
本期加权平均净值利润率	4.07%
本期基金份额净值增长率	4.43%
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	84,476,765.39
期末可供分配基金份额利润	0.6814
期末基金资产净值	309,797,044.26
期末基金份额净值	2.499
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	149.90%

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

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

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

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

低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.46%	1.30%	4.67%	0.97%	-2.21%	0.33%
过去三个月	13.38%	1.15%	15.35%	0.93%	-1.97%	0.22%
过去六个月	4.43%	1.44%	8.97%	1.19%	-4.54%	0.25%
过去一年	15.21%	1.57%	23.84%	1.34%	-8.63%	0.23%
过去三年	70.00%	1.64%	57.17%	1.44%	12.83%	0.20%
自基金合同生效起至今	149.90%	1.99%	147.00%	1.62%	2.90%	0.37%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

景顺长城中小创精选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：本基金将基金资产的 80%–95% 投资于股票资产，其中投资于中小创主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的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 2014 年 4 月 30 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合均达到上述投资组合比例的要求。自 2021 年 4 月 6 日起，“景顺长城中小创精选股票型证券投资基金”的基金名称变更为“景顺长城中小创精选股票型证券投资基金”。

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		
李孟海	本基金的基金经理	2015 年 3 月 3 日	-	13 年	工学硕士。曾任天相投资顾问公司投资分析部小组主管。2010 年 8 月加入本公司，担任研究部研究员，自 2015 年 3 月起担任股票投资部基金经理。具有 13 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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投

资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中小创精选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

国内方面，整个二季度的数据持续验证经济扩张动能边际减弱的判断，GDP 增速因基数抬升的影响而降至 7.9%，低于市场平均预测的 8.5%，在剔除基数效应之后我们发现二季度经济增长动能边际放缓，下半年经济增速将继续回落，5-6% 的潜在经济增长区间可能是合意水平，四季度可能是全年压力最大的时间点，整体经济走势无论是否剔除基数效应都大概率呈现前高后低的走势。

最新公布的 6 月份经济数据整体表现较为平淡，结构表现基本上不变，工业生产边际降速；需求端，房地产投资继续降速、基建投资同比维持负值、制造业投资温和修复，6 月份消费恢复有所加快但仍偏弱，出口继续维持高增但存在隐忧。上半年经济增长的主要支撑依旧来自于出口以及房地产投资，除了房地产行业受到政策的持续约束，出口方面已出现边际走弱迹象，例如 6 月 PMI 新出口订单进一步下滑，目前已连续几个月回落，我们认为下半年出口高景气的持续性将受到进一步挑战，这也意味着上半年的两大支撑在下半年都可能趋弱，即便后续政府债券发行加速、基建投资逐步回暖，但控制政府隐性债务等取向使得基建投资至多仅能部分对冲下行压力，整体经济在扣除基数效应之后预计大体上呈现出前高后低的走势。但需要注意的是，目前来看经

济仍没有失速下滑的风险。5 月应当是全年 PPI 同比高点，后续高位震荡下行。二季度“紧信用”的逻辑进一步得到增强，社融增速下滑幅度并未出现放缓，按照目前的节奏线性外推全年社融同比下调至 10.2% 附近，下半年社融增速的降速将放缓。货币政策方面，最新的变化是央行超预期宣布了全面降准，这可能意味着货币政策态度的边际变化，下半年无论考虑经济还是政策的连续性，货币政策不存在收紧的风险。

海外经济目前仍处于修复过程之中，在 5 月份全球制造业 PMI 报 56 创新高之后，6 月边际下滑至 55.5，按照中国的经验，疫情低点到高点大致经历 3 个季度，如果经验可借鉴，可以大致判断包括美国在内的全球经济修复可能目前已经处于顶部区间，扩张动能后续可能逐步减缓。美国经济数据方面，通胀数据继续超预期抬升，5 月零售数据环比低于预期且同比明显下滑，非农就业情况 4、5 月均低于市场预期，最新的 6 月数据仅略好于预期，事实上除通胀之外，海外整体经济表现并不强劲，目前市场对此的解释更多聚焦于补贴等因素的扭曲，但后续可能需要关注居民储蓄是否能得到释放、房地产投资是否有起色、补贴逐步停止之后就业是否有改善，三季度可能是验证的重要时间点，从目前的情况来看，这三者偏向于负面的概率似乎更大。政策方面，美联储在最新一次议息会议中基调转“鹰”，除了调高通胀与经济预期之外，还对 Tapper 进行了讨论，点阵图显示 2023 年底之前将加息 2 次，政策收紧预期升温，鲍威尔在最近一次国会听证延续了这一基调，“观望”意味较重，我们预计美联储宣布实施 Tapper 的时间点可能在三季度变得更加明朗，最早可能出现在今年四季度末，事实上这可能也是三季度中国资本市场面临的主要外部风险因素。

市场方面，上半年上证综指、上证 50、沪深 300 分别上涨 3.4%、-3.9%、0.2%；中小板、创业板指数分别上涨 3.7%、17.2%。涨幅居前的行业分别为基础化工、钢铁、电力设备、煤炭、有色金属，分别上涨 25.73%、24.69%、24.32%、17.51%、15.34%；跌幅居前的行业分别为非银行金融、家电、国防军工、房地产、农林牧渔，分别下跌 17.49%、14.38%、10.44%、9.87%、9.02%。

上半年，本基金保持较高仓位，依然坚定的基于产业的生命周期和公司的产品周期来精选优质的中小市值股票。重点配置在高壁垒仿制药制剂、顺周期成长新材料、半导体芯片、医疗信息化、公共应急安全等相关领域。行业配置上，重点配置在计算机、国防军工、医药生物、电子、化工等板块领域。

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 4.43%，业绩比较基准收益率为 8.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观场景判断仍是“稳货币、紧信用”，维持经济扩张动能减弱的判断，新增出口前景存在不

确定性，未来市场走势将更趋分化。

目前，市场整体估值并不高，金融市场流动性整体仍显宽松；高估值核心资产板块领域面对即将到来的流动性边际收缩将更为敏感、波动率将提升；而中小市值板块领域的估值整体相对不高，胜率或更高。

对于行业走势，我们最为看好高壁垒仿制药制剂、顺周期成长新材料、半导体芯片、医疗信息化、公共应急安全等领域的投资机会。同时，我们也积极布局工业互联网软件领域、国防安全核心产业链、高端进口替代新材料、导弹产业链、连接器白马龙头等具备成长性的相关领域。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—景顺长城基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中小创精选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	25,050,682.20	29,797,163.34
结算备付金		446,348.97	483,854.32
存出保证金		46,510.86	81,689.28
交易性金融资产	6.4.7.2	288,236,108.47	422,869,481.09
其中：股票投资		287,858,008.47	422,869,481.09

基金投资		-	-
债券投资		378,100.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		328,823.90	7,568,019.00
应收利息	6.4.7.5	3,880.40	5,822.74
应收股利		-	-
应收申购款		210,054.93	242,298.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		314,322,409.73	461,048,328.05
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		-	-
应付赎回款		3,823,504.88	4,227,152.53
应付管理人报酬		387,722.38	578,886.90
应付托管费		64,620.39	96,481.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	145,953.44	458,747.39
应交税费		4.20	9.91
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	103,560.18	198,766.92
负债合计		4,525,365.47	5,560,044.81
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	123,976,338.93	190,376,681.08
未分配利润	6.4.7.10	185,820,705.33	265,111,602.16
所有者权益合计		309,797,044.26	455,488,283.24
负债和所有者权益总计		314,322,409.73	461,048,328.05

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.499 元，基金份额总额 123,976,338.93 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城中小创精选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		17,352,419.12	85,958,687.99
1. 利息收入		83,107.82	168,187.38
其中：存款利息收入	6.4.7.11	82,511.03	168,141.35
债券利息收入		596.79	46.03
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）		62,189,698.79	95,532,282.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	60,117,090.34	92,651,970.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	529,945.74	247,474.63
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	1,542,662.71	2,632,837.21
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-45,212,374.80	-11,714,395.78
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	291,987.31	1,972,613.97
减：二、费用		3,551,283.83	6,513,938.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,531,425.06	4,454,854.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	421,904.18	742,475.68
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	499,816.53	1,217,783.55
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2.18	0.17
7. 其他费用	6.4.7.19	98,135.88	98,825.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,801,135.29	79,444,749.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		13,801,135.29	79,444,749.16

号填列)			
------	--	--	--

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中小创精选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）	190,376,681.08	265,111,602.16	455,488,283.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,801,135.29	13,801,135.29
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）	-66,400,342.15	-93,092,032.12	-159,492,374.27
其中：1. 基金申购款	21,436,933.32	28,761,801.85	50,198,735.17
2. 基金赎回款	-87,837,275.47	-121,853,833.97	-209,691,109.44
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）	123,976,338.93	185,820,705.33	309,797,044.26
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）	293,626,594.78	248,031,012.98	541,657,607.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	79,444,749.16	79,444,749.16
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）	-40,513,233.91	-31,476,227.10	-71,989,461.01
其中：1. 基金申购款	276,515,471.84	280,323,295.71	556,838,767.55
2. 基金赎回款	-317,028,705.75	-311,799,522.81	-628,828,228.56

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)	253,113,360.87	295,999,535.04	549,112,895.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城中小创精选股票型证券投资基金(原景顺长城中小板创业板精选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[2014]245号《关于核准景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中小板创业板精选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 281,467,138.67 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(2014)第 192 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 4 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 281,574,294.37 份,其中认购资金利息折合 107,155.70 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2021 年 3 月 12 日发布的《关于景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金修订基金合同与托管协议的公告》和 2021 年 4 月 2 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金更名的公告》,深圳证券交易所于 2021 年 4 月 6 日合并主板与中小板,经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,自 2021 年 4 月 6 日起,本基金的基金名称变更为“景顺长城中小创精选股票型证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中小创精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含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(包括中小企业私募债券)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的

相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金将基金资产的 80%-95%投资于股票资产，其中投资于中小创主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的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。本基金的业绩比较基准为：创业板综合指数 X45%+中小企业综合指数 X45%+中证全债指数 X10%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2021 年 8 月 19 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城中小创精选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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、

财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

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	25,050,682.20
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-

存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月至 1 年	-
存款期限 1 年以上	-
其他存款	-
合计	25,050,682.20

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	259,272,876.09	287,858,008.47	28,585,132.38
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	378,100.00	378,100.00
	银行间市场	-	-
	合计	378,100.00	378,100.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	259,650,976.09	288,236,108.47	28,585,132.38

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	3,645.97
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	180.81
应收债券利息	34.81
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	18.81
合计	3,880.40

6.4.7.6 其他资产

本基金本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	145,953.44
银行间市场应付交易费用	-
合计	145,953.44

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	9,340.63
应付证券出借违约金	-
预提费用	94,219.55
合计	103,560.18

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	190,376,681.08	190,376,681.08
本期申购	21,436,933.32	21,436,933.32
本期赎回（以“-”号填列）	-87,837,275.47	-87,837,275.47
- 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	123,976,338.93	123,976,338.93

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	50,892,420.89	214,219,181.27	265,111,602.16

本期利润	59,013,510.09	-45,212,374.80	13,801,135.29
本期基金份额交易产生的变动数	-25,429,165.59	-67,662,866.53	-93,092,032.12
其中：基金申购款	8,883,345.55	19,878,456.30	28,761,801.85
基金赎回款	-34,312,511.14	-87,541,322.83	-121,853,833.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	84,476,765.39	101,343,939.94	185,820,705.33

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	80,125.96
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,933.00
其他	452.07
合计	82,511.03

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	215,235,609.37
减：卖出股票成本总额	155,118,519.03
买卖股票差价收入	60,117,090.34

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	3,003,625.87
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,473,100.00
减：应收利息总额	580.13
买卖债券差价收入	529,945.74

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	1,542,662.71

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	1,542,662.71

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	-45,212,374.80
股票投资	-45,212,374.80
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	-45,212,374.80

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	276,097.92
基金转换费收入	15,889.39
合计	291,987.31

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 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	499,816.53
银行间市场交易费用	-
合计	499,816.53

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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,856.33
其他	60.00
合计	98,135.88

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 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	2,531,425.06	4,454,854.10
其中：支付销售机构的客户维护费	1,016,381.66	1,828,430.63

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：

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

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	421,904.18	742,475.68

注：支付基金托管人中国农业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：

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

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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期和上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期	25,050,682.20	80,125.96	39,864,343.74	162,163.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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	576	14,169.60	93,888.00	-
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	-

		日	日								
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	492	12,147.48	15,601.32		-
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	399	8,502.69	19,926.06		-
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		-
300948	冠中生态	2021年 2月18 日	2021年 8月25 日	新股流 通受限	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72		-
300948	冠中生态	2021年 6月4 日	2021年 8月25 日	新股流 通受限	-	27.42	108	-	2,961.36		-
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	256	12,116.48	64,501.76		-
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	2021年	2021年	新股流	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58		-

	海纳	3月23日	9月30日	通受限						
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	327	9,247.56	37,837.17	-
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	-

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
127038	国微转债	2021年6月10日	2021年7月14日	新债流通受限	100.00	100.00	3,781	378,100.00	378,100.00	-

注：1. 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。

2. 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 0.12%（上年末：0.0%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一

方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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	25,050,682.20	-	-	-	-	-	25,050,682.20
结算备付金	446,348.97	-	-	-	-	-	446,348.97
存出保证金	46,510.86	-	-	-	-	-	46,510.86
交易性金融资产	-	-	-	-	378,100.00	287,858,008.47	288,236,108.47
应收利息	-	-	-	-	-	3,880.40	3,880.40
应收申购款	-	-	-	-	-	210,054.93	210,054.93
应收证券清算款	-	-	-	-	-	328,823.90	328,823.90
资产总计	25,543,542.03	-	-	-	378,100.00	288,400,767.70	314,322,409.73
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,823,504.88	3,823,504.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	387,722.38	387,722.38
应付托管费	-	-	-	-	-	64,620.39	64,620.39
应付交易费用	-	-	-	-	-	145,953.44	145,953.44
应交税费	-	-	-	-	-	4.20	4.20
其他负债	-	-	-	-	-	103,560.18	103,560.18
负债总计	-	-	-	-	-	4,525,365.47	4,525,365.47
利率敏感度缺口	25,543,542.03	-	-	-	378,100.00	-	-
上年度末 2020年12月31	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

目							
资产							
银行存款	29,797,163.34	-	-	-	-	-	29,797,163.34
结算备付金	483,854.32	-	-	-	-	-	483,854.32
存出保证金	81,689.28	-	-	-	-	-	81,689.28
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-422,869,481.09	422,869,481.09
应收利息	-	-	-	-	-	5,822.74	5,822.74
应收申购款	-	-	-	-	-	242,298.28	242,298.28
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,568,019.00	7,568,019.00
资产总计	30,362,706.94	-	-	-	-	-430,685,621.11	461,048,328.05
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,227,152.53	4,227,152.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	578,886.90	578,886.90
应付托管费	-	-	-	-	-	96,481.16	96,481.16
应付交易费用	-	-	-	-	-	458,747.39	458,747.39
应交税费	-	-	-	-	-	9.91	9.91
其他负债	-	-	-	-	-	198,766.92	198,766.92
负债总计	-	-	-	-	-	5,560,044.81	5,560,044.81
利率敏感度缺口	30,362,706.94	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.12%（上年末：0.0%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	287,858,008.47	92.92	422,869,481.09	92.84
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	287,858,008.47	92.92	422,869,481.09	92.84

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%	12,221,076.40	25,849,872.64
	沪深 300 指数下降 5%	-12,221,076.40	-25,849,872.64

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 287,264,203.62 元，划分为第二层次的余额为人民币 971,904.85 元，无划分为第三层次的余额(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 421,415,544.79 元,属于第二层次的余额为 1,453,936.30 元,无第三层次的余额)。

(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	287,858,008.47	91.58
	其中:股票	287,858,008.47	91.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	378,100.00	0.12
	其中:债券	378,100.00	0.12
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	25,497,031.17	8.11
8	其他各项资产	589,270.09	0.19

9	合计	314,322,409.73	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	306,738.78	0.10
B	采矿业	-	-
C	制造业	197,147,919.31	63.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	31,044.70	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	20,720.04	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	84,630,702.31	27.32
J	金融业	5,670,525.00	1.83
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,920.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	287,858,008.47	92.92

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	300630	普利制药	477,855	25,039,602.00	8.08
2	002001	新和成	824,160	23,636,908.80	7.63
3	002049	紫光国微	152,964	23,585,519.16	7.61
4	300523	辰安科技	934,666	22,674,997.16	7.32
5	300253	卫宁健康	1,366,251	22,228,903.77	7.18
6	300378	鼎捷软件	912,427	19,589,807.69	6.32

7	002025	航天电器	350,701	17,594,669.17	5.68
8	300699	光威复材	210,480	15,985,956.00	5.16
9	300395	菲利华	328,828	15,856,086.16	5.12
10	002179	中航光电	196,382	15,518,105.64	5.01
11	300775	三角防务	324,700	12,403,540.00	4.00
12	300674	宇信科技	625,760	11,695,454.40	3.78
13	300790	宇瞳光学	333,780	11,325,155.40	3.66
14	300316	晶盛机电	223,616	11,292,608.00	3.65
15	002933	新兴装备	401,713	10,271,801.41	3.32
16	300445	康斯特	694,620	9,134,253.00	2.95
17	002555	三七互娱	338,500	8,130,770.00	2.62
18	002966	苏州银行	771,500	5,670,525.00	1.83
19	002191	劲嘉股份	425,100	4,523,064.00	1.46
20	002299	圣农发展	12,600	300,888.00	0.10
21	002777	久远银海	12,700	224,663.00	0.07
22	300741	华宝股份	4,200	213,024.00	0.07
23	300747	锐科激光	1,260	143,715.60	0.05
24	300545	联得装备	5,500	127,985.00	0.04
25	300919	中伟股份	576	93,888.00	0.03
26	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
27	300957	贝泰妮	256	64,501.76	0.02
28	002063	远光软件	7,080	56,002.80	0.02
29	300973	立高食品	327	37,837.17	0.01
30	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
31	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
32	300873	海晨股份	484	20,720.04	0.01
33	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
34	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
35	300932	三友联众	492	15,601.32	0.01
36	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
37	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
38	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
39	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
40	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
41	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
42	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
43	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
44	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
45	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
46	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
47	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
48	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00

49	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
50	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
51	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
52	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
53	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
54	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
55	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
56	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
57	300133	华策影视	1,000	5,920.00	0.00
58	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
59	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
60	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
61	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
62	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
63	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
64	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	002933	新兴装备	9,424,561.00	2.07
2	300790	宇瞳光学	9,136,947.00	2.01
3	300777	中简科技	8,891,938.00	1.95
4	300036	超图软件	8,709,408.82	1.91
5	002555	三七互娱	8,351,390.05	1.83
6	002966	苏州银行	6,093,940.41	1.34
7	002191	劲嘉股份	4,493,384.00	0.99
8	300545	联得装备	3,092,545.00	0.68
9	300378	鼎捷软件	2,829,459.00	0.62
10	002396	星网锐捷	1,565,129.46	0.34
11	300741	华宝股份	474,396.00	0.10
12	002299	圣农发展	325,929.00	0.07
13	002777	久远银海	253,346.00	0.06
14	300932	三友联众	121,425.42	0.03
15	300957	贝泰妮	120,975.48	0.03
16	301009	可靠股份	100,407.78	0.02
17	300973	立高食品	92,277.64	0.02
18	300941	创识科技	85,005.59	0.02
19	300968	格林精密	79,829.40	0.02
20	301006	迈拓股份	72,835.42	0.02

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	300747	锐科激光	43,781,390.79	9.61
2	300316	晶盛机电	40,178,810.10	8.82
3	002138	顺络电子	30,084,265.50	6.60
4	002449	国星光电	29,347,770.95	6.44
5	300687	赛意信息	13,354,672.22	2.93
6	300777	中简科技	11,571,346.71	2.54
7	300036	超图软件	7,497,277.00	1.65
8	300630	普利制药	6,147,168.65	1.35
9	002179	中航光电	5,481,923.00	1.20
10	300445	康斯特	3,956,459.40	0.87
11	300545	联得装备	3,111,964.00	0.68
12	300395	菲利华	2,269,677.00	0.50
13	300378	鼎捷软件	2,254,269.00	0.49
14	300775	三角防务	1,969,643.00	0.43
15	300699	光威复材	1,631,618.00	0.36
16	002396	星网锐捷	1,599,786.00	0.35
17	002191	劲嘉股份	969,211.00	0.21
18	002063	远光软件	891,700.00	0.20
19	002281	光迅科技	879,511.00	0.19
20	002933	新兴装备	404,723.00	0.09

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	65,319,421.21
卖出股票收入（成交）总额	215,235,609.37

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）	378,100.00	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	378,100.00	0.12

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127038	国微转债	3,781	378,100.00	0.12

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

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。

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。

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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

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

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	46,510.86
2	应收证券清算款	328,823.90
3	应收股利	-
4	应收利息	3,880.40
5	应收申购款	210,054.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	589,270.09

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 (%)
26,136	4,743.51	221,796.37	0.18	123,754,542.56	99.82

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	19,130.51	0.015431

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 (2014 年 4 月 30 日) 基金份额总额	281,574,294.37
本报告期期初基金份额总额	190,376,681.08
本报告期基金总申购份额	21,436,933.32
减：本报告期基金总赎回份额	87,837,275.47
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	123,976,338.93

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：

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

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	
国盛证券有限责任公司	1	77,944,324.00	27.95%	72,590.20	27.95%	-
中泰证券股份有限公司	2	37,955,140.95	13.61%	35,348.02	13.61%	-
长江证券股份有限公司	2	37,073,552.52	13.29%	34,526.59	13.29%	-
光大证券股份有限公司	2	31,068,722.45	11.14%	28,934.05	11.14%	-
中国银河证券股份有限公司	2	18,839,300.27	6.76%	17,545.01	6.76%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	15,067,527.04	5.40%	14,032.28	5.40%	-
东兴证券股份有限公司	1	14,285,073.10	5.12%	13,303.87	5.12%	-
申万宏源证券有限公司	1	13,234,792.17	4.75%	12,325.44	4.75%	-
东北证券股份有限公司	1	12,069,111.81	4.33%	11,239.98	4.33%	-

方正证券股份有限公司	2	10,332,851.53	3.71%	9,622.79	3.71%	-
中国国际金融股份有限公司	2	5,171,865.47	1.85%	4,816.53	1.85%	-
安信证券股份有限公司	1	2,086,698.46	0.75%	1,943.29	0.75%	-
新时代证券股份有限公司	1	1,899,428.30	0.68%	1,768.98	0.68%	-
申港证券股份有限公司	1	1,044,050.04	0.37%	972.31	0.37%	-
东方证券股份有限公司	2	503,200.00	0.18%	468.63	0.18%	-
川财证券有限责任公司	1	302,345.00	0.11%	281.60	0.11%	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、本基金本期交易单元未发生变更。

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
国盛证券有限责任公司	915,394.53	30.48%	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1,328,900.40	44.24%	-	-	-	-

长江证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	759,330.94	25.28%	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份 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	-	-	-	-	-	-
新时代证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
申港证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-

华福证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-08
2	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
3	景顺长城基金管理有限公司关于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
4	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
5	景顺长城中小板创业板精选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
6	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
7	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
8	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-25
9	关于景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金修订基金合同与托管	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12

	协议的公告		
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旗下部分基金参加国金证券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	2021-03-26
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-26
16	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
17	景顺长城中小板创业板精选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
18	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-30
19	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金更名的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
21	景顺长城中小创精选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	2021-04-02
22	景顺长城中小创精选股票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	2021-04-02
23	景顺长城中小创精选股票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	2021-04-02
24	景顺长城中小创精选股票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	2021-04-02
25	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-12
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	2021-04-15
27	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-19

28	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
29	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
30	景顺长城中小创精选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
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	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
33	关于旗下部分基金新增腾安基金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、赎回费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-14
34	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-20
35	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
36	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
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	2021-06-18
38	景顺长城中小创精选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
39	景顺长城中小创精选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
40	景顺长城中小创精选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

1、根据深圳证券交易所《关于合并主板与中小板相关安排的通知》，合并主板与中小板于 2021 年 4 月 6 日正式实施。根据我司于 2021 年 3 月 12 日发布的《关于景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金修订基金合同与托管协议的公告》，自 2021 年 4 月 6 日起，变更景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金名称，变更前基金名称为“景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金”，变更后基金名称为“景顺长城中小创精选股票型证券投资基金”，变更前基金简称为“景顺长城中小板创业板精选股票”，变更后基金简称为“景顺长城中小创

精选股票”，更名后本基金的基金代码不变，基金合同中其他涉及中小板的表述也进行了相应修改。修订后的基金《基金合同》、《托管协议》自 2021 年 4 月 6 日起生效。有关详细信息参见本公司于 2021 年 3 月 12 日和 2021 年 4 月 2 日发布的相关公告。

2、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中小创精选股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中小创精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中小创精选股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中小创精选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