

景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 28 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 24 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 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	5
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
8.3 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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
8.6 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.....	53
8.7 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.....	53
8.8 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.....	53
8.9 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.....	53
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
8.12 投资组合报告附注	54
§9 基金份额持有人信息.....	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
9.3 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.....	55
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	55
§10 开放式基金份额变动	55
§11 重大事件揭示	55
11.1 基金份额持有人大会决议	55
11.2 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.....	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
11.4 基金投资策略的改变	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
11.8 其他重大事件	60
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
12.1 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	64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§13 备查文件目录	64
13.1 备查文件目录	64
13.2 存放地点	64
13.3 查阅方式	64

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城公司治理混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城公司治理混合
场内简称	无
基金主代码	260111
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 10 月 22 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	151,615,996.55 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于具有良好公司治理的上市公司的股票，以及因治理结构改善而使公司内部管理得到明显提升的上市公司的股票，在控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金依据以宏观经济分析模型 (MEM) 为基础的资产配置模型决定基金的资产配置，运用景顺长城“股票研究数据库 (SRD)”等分析系统，基于公司治理评价体系和 FVMC 等选股模型作为个股选择的依据，同时依据景顺长城风险管理系统和绩效评估系统进行投资组合的调整，以谋求基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+中证全债指数×20%。
风险收益特征	本基金是风险程度高的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	郭明
	联系电话	0755-82370388	(010) 66105799
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755-22381339	(010) 66105798
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		李进	陈四清

2.4 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网	www.igwfm.com

址	
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	68,641,642.24	20,857,717.34	9,993,239.16
本期利润	93,418,260.21	44,858,645.34	18,151,990.45
加权平均基金份额本期利润	0.6912	0.6883	0.3237
本期加权平均净值利润率	35.92%	46.59%	26.55%
本期基金份额净值增长率	44.63%	54.47%	33.37%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	114,976,841.98	77,088,452.64	16,460,022.32
期末可供分配基金份额利润	0.7583	0.5646	0.2026
期末基金资产净值	351,112,630.80	258,956,724.30	108,431,012.11
期末基金份额净值	2.316	1.897	1.335
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	440.95%	274.04%	142.14%

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

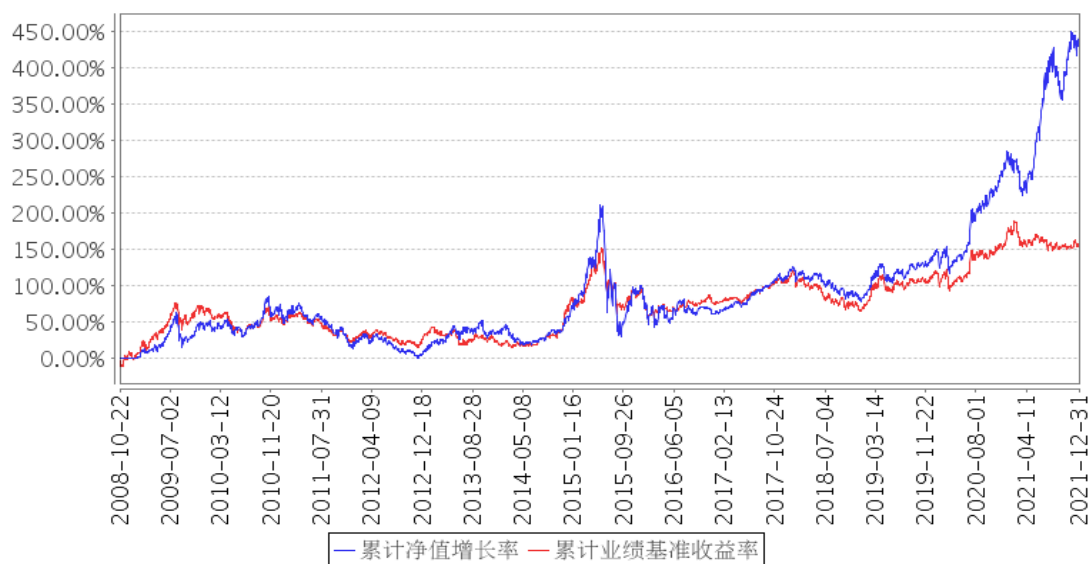
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	①—③	②—④

				④		
过去三个月	15.45%	1.17%	1.52%	0.63%	13.93%	0.54%
过去六个月	18.28%	1.47%	-3.65%	0.82%	21.93%	0.65%
过去一年	44.63%	1.44%	-2.86%	0.94%	47.49%	0.50%
过去三年	197.95%	1.29%	54.18%	1.03%	143.77%	0.26%
过去五年	232.54%	1.13%	45.91%	0.96%	186.63%	0.17%
自基金合同生效起至今	440.95%	1.59%	157.16%	1.22%	283.79%	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

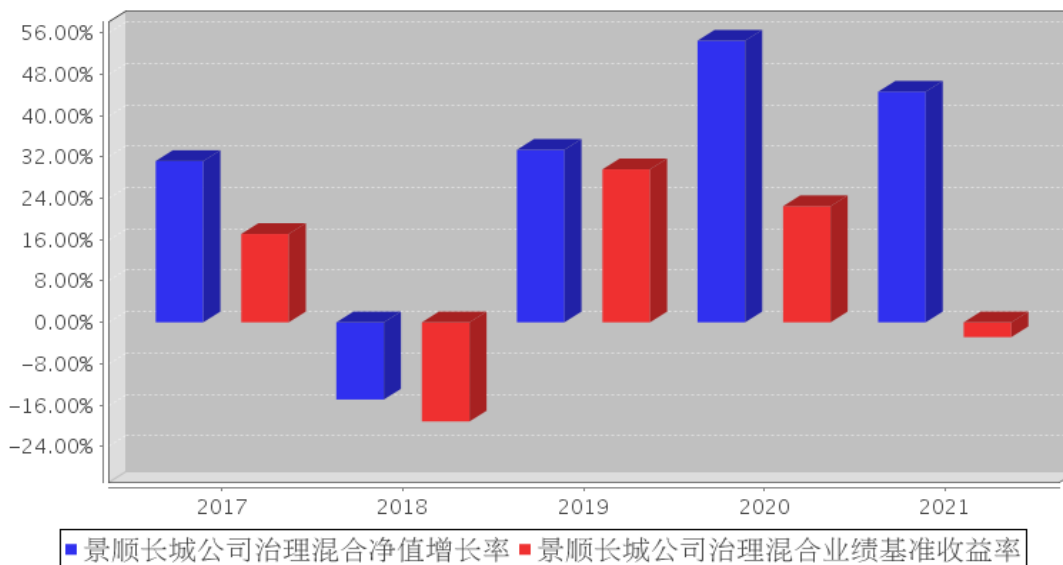
景顺长城公司治理混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的资产配置比例为：股票投资 65%–95%，债券投资 0%–30%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%–35%，权证投资 0%–3%。本基金投资于基金名称显示投资方向的股票不低于基金股票投资的 80%；本基金自 2008 年 10 月 22 日合同生效日起至 2009 年 4 月 21 日为建仓期。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城公司治理混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	3.000	29,546,325.26	9,615,565.34	39,161,890.60	-
2020 年	1.100	7,413,772.46	1,486,037.64	8,899,810.10	-
2019 年	-	-	-	-	-
合计	4.100	36,960,097.72	11,101,602.98	48,061,700.70	-

§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“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，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2021年12月31日，本公司

旗下共管理 140 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

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		
杨锐文	本基金的基金经理	2020 年 7 月 25 日	-	11 年	工学硕士、理学硕士。曾任上海常春藤衍生投资公司分析部高级分析师。2010 年 11 月加入本公司，担任研究部研究员，自 2014 年 10 月起担任股票投资部基金经理，现任股票投资部执行总监、基金经理。具有 11 年证券、基金行业从业经验。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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、《景顺长城公司治理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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公

司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 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投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 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 25 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

本年度，全球新冠疫情不断反复，资本市场处于大幅波动的状态。不同行业间表现方差极大，其中周期股大幅上涨，新能源相关及中小市值股票表现活跃，创业板与中小板指分别上涨 12.0%、4.6%，而沪深 300 则下跌 5.2%。

本年度，我们坚守的公司整体表现较佳，跑赢基准。市场变化莫测，不管市场如何变化，我们依然坚持投资具有伟大前景的新兴产业企业，并伴随他们成长，而不是趋势增强、寻求市场热点。我们相信未来的胜者一定是不断高强度投入的企业。尽管这些企业不一定是当前的焦点，但是，我们相信厚积薄发才能换取长期的发展。尽管这个过程充满艰难与痛苦，我们仍会坚持我们的选择和风格，我们也会不断优化和改进我们的持仓组合。本基金始终坚持投资于符合产业趋势的真正的成长股，基金仓位处于基金合同规定仓位限制中的高仓位（88%-95%）。

由于四季报与年报相隔较近，我们的观点没有改变，因此，报告内容与四季报保持一致，我们继续坚守我们的认知和观点进行投资。

我们在三季报表达了相对谨慎的态度，同时认为涨价周期股的上涨已经告一段落，四季度有可能反着来走。四季度的市场也基本如我们预计一样的走势，能耗双控一刀切的政策也得到了纠偏，涨价周期股也出现了大幅度回调。四季度，房地产市场急剧冰冻，土地市场大面积流拍，民营房企连环暴雷，地产的黄金时代已经走向尾声了。哪怕后面央行再度放松流动性或相关政策，

民营房企都会走向资产负债表衰退的状态，过去胆大的都要走向去杠杆，市场将进入国企主导的时代。今年下半年，各地都在加强税收规范的力度，过去各种税收筹划带来偷税漏税的灰色地带将被彻底消灭，2022 年注定是税收大年。推进共同富裕，加强二次分配力度，这或许将对奢侈品消费带来不利影响，但是，也有望让低迷的大众消费复苏。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年度，本基金份额净值增长率为 44.63%，业绩比较基准收益率为-2.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，在地产陷入冰冻期之后，经济增长的挑战是巨大的。面对这些挑战，我们预计稳增长措施将会陆续出台，强有力的财政政策以及宽松的货币政策预计将双管齐下。宽松的货币政策带来流动性溢出也是不可避免的，在我们强有力的外汇管制下，资本市场预计是流动性的主要去向。由于地产不仅规模大，且产业链长，稳增长政策也离不开激活地产市场。我们预计地产市场将会适度放松需求政策，并加快国企、央企进入地产市场维稳，地产市场将逐步进入相对良性状态。

从过去的历史来看，在流动性充裕的年份，A 股从来没有表现差过。然而，市场的主要风险可能不是来自国内，更有可能是来自海外。美国的通胀压力及可能带来的加息周期，这将对全球流动性及风险偏好带来冲击。从过去十年的数据来看，美国的服务业一直都处于通胀的状态，低通胀率主要是中国制造带来的商品通缩。如果中国制造进入涨价周期，美国通胀的确不是暂时的压力。国内的流动性往宽松发展，海外的流动性可能是往收紧发展，对比之下，两者表现可能差异很大。海外波动更有可能是对 A 股的风险偏好一次性打击，理论上并不会影响 A 股走牛的趋势。在国内流动性过剩的大背景下，A 股市场就像身处在肥皂水中，更可能出现的是泡沫不断的诞生与湮灭，市场很难出现大级别的调整，更有可能是轮动式结构行情。

A 股的机会来自哪？稳增长相关的行业会出现阶段性机会，地产及相关产业链或许也将会有有一定的估值修复。但是，这些都是阶段性机会，都不是未来。我们投资依旧要选择未来，因此，我们认为优质的科技龙头白马股以及以专精特新为代表的中小市值龙头的机会更大。2021 年，大市值股票均出现大幅调整，部分严重高估和长期透支的白马股的下跌可能是一去不复返，但是，普跌的过程一定会存在不少错杀的机会。另外，中小市值公司经过多年估值消化，已经出现一批估值合理且高成长性的标的，这里面蕴藏着很多机会。

历史上，无论 A 股还是美股均演绎过宽松流动性之下的中小盘牛市，即使在经济滞胀的背景之下，例如 2013-2015 年的 A 股以及第二次原油危机的美股。

2021 年，有色金属、钢铁煤炭、化工等大宗商品价格纷纷暴涨，新冠疫情引发的供需错配几

乎带来所有上游原材料的暴涨。尽管终端产品价格也有所顺价，但是，中游制造业不可能完全传导成本压力，2021 年几乎是制造业成本压力最大的年度。随着能耗双控一刀切的政策纠偏，资源品价格大概率是回调的态势。因此，我们预计 2022 年的制造业企业的业绩将很好看，市场的焦点会偏向于科技与制造相关的股票。

我们看好的方向

半导体

三季度，我们在季报中继续表达看好半导体，但是，半导体表现依然不尽如人意。市场依然停留在把半导体视为炒景气度的方向，但是，我们依然需要强调这次半导体的机会不是一次性机会，而是长期的机会。这次半导体不仅仅是缺芯带来的量价齐升，更重要的意义是中国半导体企业走向高端化的进程在加速。

2021 年是半导体价格普涨的年份，分不出什么是 alpha，什么是 beta。2022 年将清晰可以看到哪些公司实现了产品和领域的突破，哪些公司只是缺芯涨价带来的鸡犬升天。半导体产业的景气度肯定走向分化。由于手机、笔记本和电视等消费电子需求低迷，台积电过去的投资主要集中于先进制程，然而，先进制程主要应用在手机、笔记本等消费电子产品上，因此，先进制程芯片以及存储类芯片可能会率先出现过剩的状态。由于过去成熟制程的产能的投资偏少，需求则受新能源汽车等影响超预期增长，预计 2022 年产能供给释放依然是有限的，产能依旧维持紧缺。因此，成熟制程的投资机会将会优于先进制程。但是，无论成熟制程还是先进制程，更重要的是寻找产品和领域突破的公司，这才是持续增长的长期动力。

我们半导体的投资依然围绕着以下几个方面展开：

1、 产能依然为王，景气度分化，长期看好功率半导体和汽车半导体。

经过这次严重缺芯的影响，无论哪家主流晶圆厂都被客户锁定两年及以上的产能，所以，根本无需担忧现有的晶圆厂的盈利能力。更重要是探寻哪些晶圆厂会在长期竞争当中胜出，尤其今天晶圆厂大规模扩产的过程中，技术和特色工艺将尤其重要。

就细分领域而言，我们尤其看好功率半导体的发展，因为新能源车、光伏风电、储能等碳中和领域会大量使用 IGBT/MOS 以及 SiC 等功率半导体。过去，功率半导体的需求增长相对稳定，主流晶圆厂和 IDM 企业的扩张同样是缓慢的，然而，碳中和的突然爆发成为前所未有的强驱动力。从供给端来看，由于二手 8 寸设备一台难求，更多只能依靠 12 寸线的扩产，然而扩产周期又长达 2.5-3 年，还需要特殊工艺支撑，功率半导体的供给释放速度是缓慢的。供需失衡将持续较长时间，这对中国的 Fab 厂和 IDM 企业都是历史性机遇，尤其对于 IDM 企业更是产品走向高端化的关键时刻。除功率半导体之外，TI、英飞凌、安森美等海外企业回防汽车芯片，势必会让出很多领

域和空缺，这对国内相关功率、模拟的企业都是历史性机遇。

除了功率半导体之外，我们同样看好汽车半导体的爆发。汽车半导体不限于功率半导体，根据我们的测算，一辆 L4 级别的电动智能汽车的半导体价值量将高达 1.5 万元以上，从晶圆消耗角度来看，一辆 L4 级别的电动车将近消耗掉一张 8 寸的晶圆，因此，L4 及以上的电动智能车的半导体用量将是传统燃油车的 5-10 倍。随着汽车的电动智能化的推进，汽车半导体将呈现倍数级别的增长，整个车规级半导体市场最终可能达到将近万亿级别。从供给角度，由于车规半导体主要是以海外 IDM 企业为主导，考虑到海外企业的扩产效率和速率较低，车规半导体的供给释放速度将不容乐观，车规半导体的紧缺可能将长期存在。无论从供给角度还是需求角度，未来十年的车规级半导体必然精彩纷呈。

2、 技术壁垒与产品特性是芯片设计公司的选择关键。

由于资本的疯狂追逐，初创型芯片设计公司像雨后春笋涌现。如果芯片的技术壁垒不是足够深厚，竞争格局很快会出现恶化。因此，芯片设计公司的技术壁垒评估尤其重要。

另外，不同芯片设计公司的产品种类不一样，短周期产品的爆发力更强，但是持续能力较弱。长周期产品的爆发力稍弱，但是持续能力较强。我们投资中更偏好有高技术壁垒的长周期产品的芯片设计公司。

3、 随着国内晶圆厂大规模投建，中国的半导体设备和材料公司将会面临历史性的机遇。

由于半导体材料具有极高的技术壁垒和广阔的潜在市场空间，与芯片设计公司和半导体设备公司相比，同样估值的情况下，我们优选投资半导体材料公司。

以上分析仅是我们投资半导体的基本逻辑和框架，我们的分享希望投资者了解我们对半导体投资的一些思考。

电动智能汽车

电动智能汽车是 2021 年大热行业，各种机会频出，毋庸置疑是去年最耀眼的那颗星。然而 2022 年会是怎么样？我们认为 2021 年的电动化是全面性 beta 行情，但是，到 2022 年电动化将会出现明显的分化，我们更多需要寻找 alpha 的机会。从智能化的角度，尽管汽车整车销量受制于缺芯的影响，但是汽车智能化依然推进神速。随着未来汽车缺芯的逐步缓解以及 L3 智能化的起航，智能化将会呈现爆发趋势，这或许将迎来全面性的 beta 机会。

2021 年，电动车销量数据不断超市场预期，从年初预期销量 180 万辆，连续三次上调到 330 万辆。新能源的上游锂矿和各种化工材料由于阶段性的供需紧张出现了价格大幅上涨，这对电池企业和整车企业均带来明显的成本压力。从 2022 年伊始，不少电池企业给下游整车企业下达 10-30%不等的涨价通知书，考虑到新一年退补 30%的影响，其他环节的年降势必无法承担电池部

分的上涨，那么，终端价格上涨是必然的。我们清楚，终端价格上涨势必减缓电动车的替代节奏，因此，对 2022 年过高的销量预期是不现实的。实际上，过热的市场对产业的发展是不利的，中上游材料的价格过度上涨已经带来了很多的新进入者，各路资本开始围堵国内外的锂矿，化工巨头也纷纷宣布进军电动车材料领域。价格上涨催生的严重过热必然会带来竞争格局的破坏，电动化未来的机会不大可能是全面性的，未来更需考究技术壁垒与竞争格局，更多机会来自新的技术方向。

电动智能化的大趋势已经是毋庸置疑的，但是，大家也要清醒认识到新能源车的发展不可能是一帆风顺的，线性增长的推演肯定是不对的，现实制约因素也会限制发展的速率。今天降低预期并非坏事，产业与过高的价格均需要降温，过快的速度同样不利于产业的配套发展。事实上，新能源汽车有三大制约因素需要解决：一是 IGBT/MOS、SiC 等车规功率半导体的配套能力是否能跟上产业发展；二是锂矿供给能力是否能跟上产业发展；三是充电桩、配电网等能否跟上产业发展；

尽管我们对市场过度乐观的新能源车销量预期泼了冷水，但是，我们深信电动智能汽车一定是未来十年最精彩的产业方向。相对 2022 年的电动化，我们更看好 2022 年的智能化的发展。实际上，智能化 2021 年表现相对平淡，主要原因是 2021 年汽车严重缺芯对智能化带来较大的冲击。智能化实际上是与汽车整体销量挂钩的，并非只挂钩电动车。然而，随着 ST 等大厂的芯片受马来疫情影响基本消除，芯片短缺问题在逐步缓解，汽车行业最艰难的时刻已经过去。缺芯过度消耗库存以及累积大量待交付订单，一旦有所缓解，汽车智能化领域的增长将重回高速通道。

电动智能化带来的改变并不局限于燃油变成电动，也会从简单的车机变成智能座舱，智能驾驶更是从无到有，且不断升级。今天，智能化程度还是车企之间的胜负手，智能化深度决定了汽车的差异化，让整车利润模型从“单价 X 销量”延伸至“软件收费 X 保有量”。可以预见，L3 智能驾驶将在 2022 年开始起航，智能化将锚准感知更精确、决策更智能、执行更快捷、应用更丰富的路径发展。L3 的起航将让激光雷达以及高精度定位成为电动智能车的必备之选，多传感器进一步融合提升整车的鲁棒性。

随着智能驾驶逐步成熟，智能座舱的空间和时间价值将得到进一步延伸，车上办公、娱乐、AR/VR 更丰富的应用将会打开全新的市场空间。这些变化将会带给我们很多不局限于电动化的投资机会。

元宇宙与 AR/VR

元宇宙是今年最火热的一个概念。2021 年 7 月，脸书 CEO 扎克伯格公开表示，2025 年前 Facebook 将全面向元宇宙公司转型。站在当下，我们无法判别元宇宙的发展速度和进程，但从逻辑

辑角度上看，作为一个虚拟的平行世界与现实世界的连接必须通过一个载体完成，而这个载体究竟是什么形态，是 AR、VR、MR 还是投影，现在还不太明晰。就我们认知而言，我们认为互联网是信息之间的连接，而元宇宙是场景之间的连接。现阶段的场景连接的技术水平距离元宇宙的要求仍有很大差距。不过，元宇宙的发展必须要有载体的全面普及，就如 PC 之于互联网，手机之于移动互联网，只有这样才能真正触达更多的人群。因此，如果元宇宙要成功，首先需要载体的出现并爆发式增长。就现在认知而言，AR/VR/MR 设备很可能作为载体的出现，那么，苹果于 2022 年推出的 MR 设备将备受关注。我们拭目以待苹果的 MR 设备的创新能否开创元宇宙载体的起点，这或许又是一场科技革命。

以“专精特新”为代表的中小市值龙头

从 2021 年开始，简单的以大为美的投资不再有效，此前被忽略的中小市值龙头逐步走出底部，市场风格似乎已经悄然发生变化。中国具有全球最大且最完善的制造业产业链集群，过去的中国企业普遍以规模为导向，大而不强，以低附加值产品为主。中国制造业自身在升级，逐步迈向中高端制造，规模不再是首要的目标，今天更需要突破高附加值产品，这就需要一批又一批的具有全球竞争力品质和技术“隐形冠军”。只有诞生越来越多这种类型的公司，才是支撑我国制造业迈向中高端过程的脊梁。

我们的投资选择

尽管我们 2021 年依旧保持我们相对稳健的表现，但是，我们好几个长期重仓股表现都不佳，我们依旧在坚持，深信他们的价值，希望能在 2022 年守得云开见月明。我们并不是极致型选手，选股也并没有追求风口浪尖。我们的投资组合不仅有为了当下的股票，也有为了未来的股票，这样才能保持短中长的平衡。如果总是追求风口浪尖，万一风口突然变化，就会非常麻烦。尤其当船大到一定程度，速度肯定变慢。如果要转变航道肯定要提前转，如果都是在冲锋到最快的时候突然转道，很有可能是翻船的结果。

希望投资者能理解我们必要的收益率舍弃，我们认为这才是确保持续稳定业绩的根本。我们会坚持从长期眼光看待每一笔投资，通过持续的跟踪动态调整持仓。投资不时就会面临四面楚歌的状态，我们只能紧盯着行业趋势，准确把握企业的基本面的锚，才能面对惊涛骇浪而岿然不动。我们深信做有价值的坚持与独立思考才能为持有人获取持续的超额收益。

关于基金的区分

我们现在管理的优选、环保优势和创新成长三只基金均定位为全行业基金，主要采取之前季报所描述的企业生命力评估的方法论策略。它们不仅会投资在企业成长爆发阶段，也会有大量投资于陪伴企业成长的早中期阶段，市值分布从 30 亿至万亿不等，行业分布也较为分散，体现为多

层次均衡式投资。

景顺长城成长龙头也定位为全行业基金，但是投资的企业会更偏重于大市值龙头成长股。

景顺长城公司治理基金和成长领航基金同样定位于均衡成长，但有较多仓位投资于以专精特新为代表的中小市值股票。

景顺长城电子信息产业与新能源产业均是团队管理的行业型基金，分别聚焦于科技股与新能源产业。由于聚焦于科技股和新能源产业，这两个基金会体现较高的波动率。我们希望通过产业切入的方式实现持续的超额收益，并通过更专业的产业投资让投资者分享产业成长的红利。

结束语

科技股可能已经不是投不投的问题，而是怎么投的问题。或许，如果忽视今天的中国科技股，就犹如十年前忽视美国科技股一样，时代的抛弃连一声再见也不会有。中华之崛起，也不可能离开科技的崛起，A 股的未来大概率也会这样演绎。我们会坚持扎根于产业，深耕科技成长，希望为投资者带来持续的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI(Key Performance Indicator 主要绩效指标)为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施了一次利润分配。截至 2020 年 12 月 31 日，本基金可供分配利润为 77,088,452.64 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 38,544,226.32 元，本基金的基金管理人已于 2021 年 1 月 13 日完成权益登记，每 10 份基金份额派发红利 3.0 元，详细信息请查阅相关分红公告。

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金可供分配利润 114,976,841.98 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 57,488,420.99 元，本基金的基金管理人已于 2022 年 1 月 14 日完成权益登记，每 10 份基金份额派发红利 3.8 元，详细信息请查阅相关分红公告。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 24430 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城公司治理混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城公司治理混合型证券投资基金(以下简称“景顺长城公司治理基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了景顺长城公司治理基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于景顺长城公司治理基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>景顺长城公司治理基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估景顺长城公司治理基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算景顺长城公司治理基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督景顺长城公司治理基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则</p>

	<p>执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。？</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对景顺长城公司治理基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城公司治理基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	单峰 郭劲扬
会计师事务所的地址	中国 上海市
审计报告日期	2022 年 3 月 24 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城公司治理混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	7.4.7.1	27,921,216.62	28,995,085.98
结算备付金		225,153.81	1,606,271.39
存出保证金		65,874.75	49,816.41
交易性金融资产	7.4.7.2	323,976,351.15	230,207,310.23
其中：股票投资		323,976,351.15	230,207,310.23
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		94,153.14	3,110,320.62
应收利息	7.4.7.5	2,688.25	3,853.23
应收股利		-	-
应收申购款		635,456.83	636,389.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		352,920,894.55	264,609,047.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		890,701.83	4,808,693.17
应付管理人报酬		439,876.96	348,647.00
应付托管费		73,312.81	58,107.86
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	212,311.08	289,812.26
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	192,061.07	147,062.96
负债合计		1,808,263.75	5,652,323.25
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	151,615,996.55	136,528,754.38
未分配利润	7.4.7.10	199,496,634.25	122,427,969.92
所有者权益合计		351,112,630.80	258,956,724.30
负债和所有者权益总计		352,920,894.55	264,609,047.55

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.316 元，基金份额总额 151,615,996.55

份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城公司治理混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		99,659,805.35	47,635,395.03
1. 利息收入		106,092.70	70,328.21
其中：存款利息收入	7.4.7.11	105,363.44	65,755.31
债券利息收入		729.26	4,572.90
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）		74,408,831.93	23,351,032.81
其中：股票投资收益	7.4.7.12	72,310,497.94	22,638,216.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	638,460.23	24,404.93
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,459,873.76	688,410.91
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	24,776,617.97	24,000,928.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	368,262.75	213,106.01
减：二、费用		6,241,545.14	2,776,749.69
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,872,257.19	1,423,121.53
2. 托管费	7.4.10.2.2	645,376.24	237,186.95
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,505,867.11	958,696.14
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 税金及附加		2.60	0.07
7. 其他费用	7.4.7.19	218,042.00	157,745.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		93,418,260.21	44,858,645.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		93,418,260.21	44,858,645.34

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城公司治理混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	136,528,754.38	122,427,969.92	258,956,724.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	93,418,260.21	93,418,260.21
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）	15,087,242.17	22,812,294.72	37,899,536.89
其中：1. 基金申购款	165,421,952.93	150,306,494.24	315,728,447.17
2. 基金赎回款	-150,334,710.76	-127,494,199.52	-277,828,910.28
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）	-	-39,161,890.60	-39,161,890.60
五、期末所有者权益（基金净值）	151,615,996.55	199,496,634.25	351,112,630.80
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	81,232,996.15	27,198,015.96	108,431,012.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,858,645.34	44,858,645.34
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）	55,295,758.23	59,271,118.72	114,566,876.95
其中：1. 基金申购款	169,838,437.75	114,746,197.93	284,584,635.68
2. 基金赎回款	-114,542,679.52	-55,475,079.21	-170,017,758.73
四、本期向基金份额持有人分	-	-8,899,810.10	-8,899,810.10

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)	136,528,754.38	122,427,969.92	258,956,724.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>康乐</u>	<u>吴建军</u>	<u>邵媛媛</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城公司治理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[2008]第 707 号《关于核准景顺长城公司治理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《景顺长城公司治理股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 273,029,372.01 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 152 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城公司治理股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 10 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 273,077,492.69 份基金份额,其中认购资金利息折合 48,120.68 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城公司治理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国内依法公开发行、上市的股票(含存托凭证)、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的比例范围为:股票投资 65%-95%,债券投资 0%-30%,现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-35%,权证投资 0%-3%。本基金投资于基金名称显示投资方向的股票不低于基金股票投资的 80%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数 X80%+中证全债指数 X20%。

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 2022 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 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》、本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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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、资产支持证券投资和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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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。

对基金通过沪港通或深港通(如有)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(如有)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(如有)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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	27,921,216.62	28,995,085.98
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1 个月(含)-3 个月	-	-
存款期限 3 个月(含)	-	-

至 1 年		
存款期限 1 年（含）以上	-	-
其他存款	-	-
合计	27,921,216.62	28,995,085.98

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	268,904,104.39	323,976,351.15	55,072,246.76
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	268,904,104.39	323,976,351.15	55,072,246.76
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	199,911,681.44	230,207,310.23	30,295,628.79
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	199,911,681.44	230,207,310.23	30,295,628.79

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末的衍生金融资产/负债余额为零。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末的买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,557.35	3,107.93
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	101.30	722.80
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	29.60	22.50
合计	2,688.25	3,853.23

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末的其他资产余额为零。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	212,311.08	289,812.26
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	212,311.08	289,812.26

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,061.07	18,062.96
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	189,000.00	129,000.00
合计	192,061.07	147,062.96

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	136,528,754.38	136,528,754.38
本期申购	165,421,952.93	165,421,952.93
本期赎回（以“-”号填列）	-150,334,710.76	-150,334,710.76

- 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	151,615,996.55	151,615,996.55

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	77,088,452.64	45,339,517.28	122,427,969.92
本期利润	68,641,642.24	24,776,617.97	93,418,260.21
本期基金份额交易产生的变动数	8,408,637.70	14,403,657.02	22,812,294.72
其中：基金申购款	80,308,457.59	69,998,036.65	150,306,494.24
基金赎回款	-71,899,819.89	-55,594,379.63	-127,494,199.52
本期已分配利润	-39,161,890.60	-	-39,161,890.60
本期末	114,976,841.98	84,519,792.27	199,496,634.25

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	98,419.34	61,091.66
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	5,818.32	4,256.36
其他	1,125.78	407.29
合计	105,363.44	65,755.31

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	490,156,606.67	285,655,784.88
减：卖出股票成本总额	417,846,108.73	263,017,567.91
买卖股票差价收入	72,310,497.94	22,638,216.97

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,078,811.20	4,742,632.29
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,439,600.00	4,614,348.00

减：应收利息总额	750.97	103,879.36
买卖债券差价收入	638,460.23	24,404.93

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,459,873.76	688,410.91
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	1,459,873.76	688,410.91

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	24,776,617.97	24,000,928.00
股票投资	24,776,617.97	24,001,977.60
债券投资	-	-1,049.60
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	24,776,617.97	24,000,928.00

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	339,156.40	201,734.68
基金转换费收入	29,106.35	11,371.33
合计	368,262.75	213,106.01

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日

交易所市场交易费用	1,505,867.11	958,696.14
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,505,867.11	958,696.14

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	60,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
债券托管账户维护费	37,200.00	37,200.00
银行划款手续费	842.00	545.00
合计	218,042.00	157,745.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2022 年 1 月 12 日宣告 2021 年度分红，向截至 2022 年 1 月 14 日止在本基金注册登记人景顺长城基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 3.8 元。

截至本财务报表批准报出日，除上述事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
长城证券	1,054,808.14	0.11	11,444,146.06	1.76

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	982.40	0.11	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	10,657.93	1.76	10,657.93	3.68

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	3,872,257.19
其中：支付销售机构的客户维护费	1,090,258.82	298,368.67

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	645,376.24	237,186.95

注：支付基金托管人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：

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

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

7.4.10.4.2 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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期	27,921,216.62	98,419.34	28,995,085.98	61,091.66

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2021年1月13日	2021年1月13日	3.000	29,546,325.26	9,615,565.34	39,161,890.60	-
合计	-	-	3.000	29,546,325.26	9,615,565.34	39,161,890.60	-

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
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	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股流通受限	22.04	56.28	390	8,595.60	21,949.20	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股流通受限	6.96	12.51	991	6,897.36	12,397.41	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301045	天禄科技	2021年8月6日	2022年2月17日	新股流通受限	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-

301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新股流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股流通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301066	万事利	2021年9月13日	2022年3月22日	新股流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301082	久盛电气	2021年10月14日	2022年4月27日	新股流通受限	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股流通受限	93.09	75.34	189	17,594.01	14,239.26	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新股流通受限	33.16	24.67	329	10,909.64	8,116.43	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	36.31	35.52	221	8,024.51	7,849.92	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	58.08	49.85	197	11,441.76	9,820.45	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股流通受限	79.60	78.53	116	9,233.60	9,109.48	-
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年5月12日	新股流通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年5月23日	新股流通受限	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	新股流通受限	27.81	31.14	401	11,151.81	12,487.14	-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	新股流通受限	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股流通受限	57.27	53.71	146	8,361.42	7,841.66	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年5月18日	新股流通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	新股流通受限	12.03	17.12	1,338	16,096.14	22,906.56	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	新股流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新股流通受限	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股流通受限	60.66	96.75	252	15,286.32	24,381.00	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	86.06	94.50	139	11,962.34	13,135.50	-
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	新股流通受限	39.08	52.13	283	11,059.64	14,752.79	-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	116.88	116.08	179	20,921.52	20,778.32	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股流通受限	43.99	50.77	185	8,138.15	9,392.45	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股流通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新股流通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新股流通受限	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	66.18	56.62	218	14,427.24	12,343.16	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股流通受限	27.85	27.46	382	10,638.70	10,489.72	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股流通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	29.28	32.00	362	10,599.36	11,584.00	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	新股流通受限	25.80	33.65	595	15,351.00	20,021.75	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股流通受限	69.89	88.72	172	12,021.08	15,259.84	-

688087	英科再生	2021年6月30日	2022年1月10日	新股流通受限	21.96	93.40	2,246	49,322.16	209,776.40	-
688162	巨一科技	2021年11月3日	2022年5月10日	新股流通受限	46.00	82.55	3,062	140,852.00	252,768.10	-
688167	炬光科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股流通受限	78.69	176.67	949	74,676.81	167,659.83	-
688255	凯尔达	2021年10月14日	2022年4月25日	新股流通受限	47.11	37.87	1,648	77,637.28	62,409.76	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股流通受限	41.98	41.98	3,044	127,787.12	127,787.12	-
688707	振华新材	2021年9月6日	2022年3月14日	新股流通受限	11.75	47.16	7,777	91,379.75	366,763.32	-
688799	华纳药厂	2021年7月5日	2022年1月13日	新股流通受限	30.82	40.73	1,862	57,386.84	75,839.26	-

注：上述流通受限证券的“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终可流通日期以上市公司公告为准。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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%。

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

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金管理人通过风险管理人员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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 个月以内	1-3 个	3 个月-1	1-5	5 年以	不计息	合计
-----	--------	-------	--------	-----	------	-----	----

2021 年 12 月 31 日		月	年	年	上		
资产							
银行存款	27,921,216.62	-	-	-	-	-	27,921,216.62
结算备付金	225,153.81	-	-	-	-	-	225,153.81
存出保证金	65,874.75	-	-	-	-	-	65,874.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-323,976,351.15	323,976,351.15
应收利息	-	-	-	-	-	2,688.25	2,688.25
应收申购款	-	-	-	-	-	635,456.83	635,456.83
应收证券清算款	-	-	-	-	-	94,153.14	94,153.14
资产总计	28,212,245.18	-	-	-	-	-324,708,649.37	352,920,894.55
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	890,701.83	890,701.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	439,876.96	439,876.96
应付托管费	-	-	-	-	-	73,312.81	73,312.81
应付交易费用	-	-	-	-	-	212,311.08	212,311.08
其他负债	-	-	-	-	-	192,061.07	192,061.07
负债总计	-	-	-	-	-	1,808,263.75	1,808,263.75
利率敏感度缺口	28,212,245.18	-	-	-	-	-	-
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	28,995,085.98	-	-	-	-	-	28,995,085.98
结算备付金	1,606,271.39	-	-	-	-	-	1,606,271.39
存出保证金	49,816.41	-	-	-	-	-	49,816.41
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-230,207,310.23	230,207,310.23
应收利息	-	-	-	-	-	3,853.23	3,853.23
应收申购款	-	-	-	-	-	636,389.69	636,389.69
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,110,320.62	3,110,320.62
资产总计	30,651,173.78	-	-	-	-	-233,957,873.77	264,609,047.55
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,808,693.17	4,808,693.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	348,647.00	348,647.00
应付托管费	-	-	-	-	-	58,107.86	58,107.86
应付交易费用	-	-	-	-	-	289,812.26	289,812.26
其他负债	-	-	-	-	-	147,062.96	147,062.96
负债总计	-	-	-	-	-	5,652,323.25	5,652,323.25
利率敏感度缺口	30,651,173.78	-	-	-	-	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	323,976,351.15	92.27	230,207,310.23	88.90
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	323,976,351.15	92.27	230,207,310.23	88.90

7.4.13.4.3.2 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12月31日)	上年度末 (2020年12月31日)	
分析	沪深 300 指数上升 5%	15,901,226.92	12,758,531.38
	沪深 300 指数下降 5%	-15,901,226.92	-12,758,531.38

7.4.14 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 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 321,917,102.65 元，属于第二层次的余额为 2,059,248.50 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 229,981,566.33 元，第二层次 225,743.90 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完

成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	323,976,351.15	91.80
	其中：股票	323,976,351.15	91.80
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	28,146,370.43	7.98
8	其他各项资产	798,172.97	0.23
9	合计	352,920,894.55	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	287,383,508.05	81.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	79,807.87	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	16,787,395.76	4.78
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00

I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,096,338.82	5.44
J	金融业	-	-
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	58,740.30	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	498,338.27	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.01
R	文化、体育和娱乐业	37,932.31	0.01
S	综合	-	-
	合计	323,976,351.15	92.27

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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	002841	视源股份	211,900	17,248,660.00	4.91
2	600460	士兰微	316,500	17,154,300.00	4.89
3	688002	睿创微纳	216,279	16,993,041.03	4.84
4	002352	顺丰控股	243,578	16,787,395.76	4.78
5	002049	紫光国微	73,204	16,470,900.00	4.69
6	688169	石头科技	19,544	15,889,272.00	4.53
7	300790	宇瞳光学	338,760	15,305,176.80	4.36
8	600418	江淮汽车	831,900	14,475,060.00	4.12
9	600745	闻泰科技	104,500	13,511,850.00	3.85
10	300207	欣旺达	320,126	13,496,512.16	3.84
11	688116	天奈科技	78,738	11,754,796.02	3.35
12	688111	金山办公	42,825	11,348,625.00	3.23
13	600210	紫江企业	1,230,100	11,292,318.00	3.22
14	300115	长盈精密	488,400	9,689,856.00	2.76
15	002409	雅克科技	106,700	8,660,839.00	2.47
16	688019	安集科技	29,326	8,011,863.20	2.28
17	601208	东材科技	452,850	7,856,947.50	2.24
18	689009	九号公司	111,510	7,813,505.70	2.23
19	688268	华特气体	85,371	7,700,464.20	2.19
20	688099	晶晨股份	57,997	7,551,209.40	2.15
21	605111	新洁能	42,100	7,498,010.00	2.14

22	603197	保隆科技	120,800	7,054,720.00	2.01
23	688798	艾为电子	32,604	7,042,464.00	2.01
24	300627	华测导航	151,400	6,964,400.00	1.98
25	688696	极米科技	11,676	6,445,152.00	1.84
26	688007	光峰科技	170,674	5,862,651.90	1.67
27	600989	宝丰能源	327,000	5,676,720.00	1.62
28	002906	华阳集团	102,453	5,630,816.88	1.60
29	688678	福立旺	170,623	5,594,728.17	1.59
30	300630	普利制药	100,000	5,504,000.00	1.57
31	688595	芯海科技	26,675	3,319,703.75	0.95
32	002126	银轮股份	258,800	3,250,528.00	0.93
33	688187	时代电气	29,126	2,388,332.00	0.68
34	000888	峨眉山 A	68,800	454,080.00	0.13
35	688707	振华新材	7,777	366,763.32	0.10
36	688162	巨一科技	3,062	252,768.10	0.07
37	688087	英科再生	2,246	209,776.40	0.06
38	688167	炬光科技	949	167,659.83	0.05
39	688262	国芯科技	3,044	127,787.12	0.04
40	301199	迈赫股份	3,612	125,821.50	0.04
41	688799	华纳药厂	1,862	75,839.26	0.02
42	688255	凯尔达	1,648	62,409.76	0.02
43	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
44	688083	中望软件	91	31,834.53	0.01
45	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.01
46	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
47	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.01
48	301155	海力风电	252	24,381.00	0.01
49	301127	天源环保	1,338	22,906.56	0.01
50	301035	润丰股份	390	21,949.20	0.01
51	301177	迪阿股份	179	20,778.32	0.01
52	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.01
53	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.01
54	301211	亨迪药业	595	20,021.75	0.01
55	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.01
56	603216	梦天家居	772	19,523.88	0.01
57	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
58	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
59	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
60	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
61	301221	光庭信息	172	15,259.84	0.00
62	301168	通灵股份	283	14,752.79	0.00
63	301087	可孚医疗	189	14,239.26	0.00

64	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
65	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
66	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
67	301166	优宁维	139	13,135.50	0.00
68	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
69	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
70	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
71	301100	风光股份	401	12,487.14	0.00
72	301039	中集车辆	991	12,397.41	0.00
73	301189	奥尼电子	218	12,343.16	0.00
74	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
75	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
76	301190	善水科技	382	10,489.72	0.00
77	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
78	301093	华兰股份	197	9,820.45	0.00
79	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
80	301179	泽宇智能	185	9,392.45	0.00
81	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
82	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
83	301096	百诚医药	116	9,109.48	0.00
84	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
85	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
86	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
87	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
88	301088	戎美股份	329	8,116.43	0.00
89	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
90	301092	争光股份	221	7,849.92	0.00
91	301108	洁雅股份	146	7,841.66	0.00
92	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
93	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
94	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
95	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
96	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
97	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
98	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
99	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
100	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
101	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
102	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
103	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
104	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
105	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00

106	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
107	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
108	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
109	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
110	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
111	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
112	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
113	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
114	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002841	视源股份	22,879,264.72	8.84
2	688002	睿创微纳	21,179,422.08	8.18
3	688169	石头科技	17,935,162.54	6.93
4	600745	闻泰科技	16,717,893.00	6.46
5	300207	欣旺达	16,697,886.00	6.45
6	688099	晶晨股份	14,140,444.13	5.46
7	688111	金山办公	12,280,351.93	4.74
8	600460	士兰微	12,023,709.00	4.64
9	002352	顺丰控股	11,781,435.52	4.55
10	300790	宇瞳光学	11,576,272.57	4.47
11	605111	新洁能	10,647,456.20	4.11
12	002409	雅克科技	10,403,018.00	4.02
13	688019	安集科技	10,364,381.71	4.00
14	300115	长盈精密	9,999,834.80	3.86
15	600418	江淮汽车	9,879,111.00	3.81
16	600111	北方稀土	9,718,566.00	3.75
17	300630	普利制药	9,002,685.00	3.48
18	600699	均胜电子	8,979,416.00	3.47
19	600210	紫江企业	8,208,031.00	3.17
20	688798	艾为电子	7,728,024.69	2.98
21	300829	金丹科技	7,282,259.80	2.81
22	601636	旗滨集团	7,274,689.06	2.81
23	688007	光峰科技	7,118,921.28	2.75
24	689009	九号公司	6,982,719.56	2.70
25	601208	东材科技	6,660,761.00	2.57
26	300627	华测导航	6,632,068.00	2.56
27	688268	华特气体	6,620,009.74	2.56

28	300994	久祺股份	6,585,206.66	2.54
29	603515	欧普照明	6,164,539.67	2.38
30	300037	新宙邦	5,956,388.00	2.30
31	002049	紫光国微	5,795,590.00	2.24
32	688696	极米科技	5,795,413.55	2.24
33	000625	长安汽车	5,655,211.00	2.18
34	002906	华阳集团	5,600,836.81	2.16
35	603160	汇顶科技	5,458,920.19	2.11
36	688595	芯海科技	5,275,212.59	2.04
37	600989	宝丰能源	5,271,789.00	2.04
38	688678	福立旺	5,207,032.05	2.01

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.2 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	300568	星源材质	24,973,665.90	9.64
2	300207	欣旺达	19,383,184.83	7.49
3	688099	晶晨股份	18,964,769.24	7.32
4	002841	视源股份	15,553,394.00	6.01
5	600893	航发动力	15,226,031.93	5.88
6	000625	长安汽车	14,328,239.00	5.53
7	603601	再升科技	14,069,321.68	5.43
8	300037	新宙邦	13,724,191.00	5.30
9	601318	中国平安	13,180,762.32	5.09
10	002049	紫光国微	12,397,639.00	4.79
11	600111	北方稀土	11,621,138.00	4.49
12	002507	涪陵榨菜	10,425,329.76	4.03
13	688299	长阳科技	10,416,694.89	4.02
14	300001	特锐德	10,044,656.00	3.88
15	601601	中国太保	10,040,417.00	3.88
16	300482	万孚生物	8,616,813.46	3.33
17	600745	闻泰科技	7,315,579.00	2.83
18	300888	稳健医疗	7,301,642.66	2.82
19	002126	银轮股份	7,296,017.19	2.82
20	300378	鼎捷软件	6,797,639.59	2.63
21	601636	旗滨集团	6,675,029.10	2.58
22	600699	均胜电子	6,593,832.00	2.55
23	300829	金丹科技	6,551,657.60	2.53
24	300994	久祺股份	6,520,319.42	2.52
25	688116	天奈科技	6,274,932.81	2.42

26	605111	新洁能	6,260,910.40	2.42
27	605305	中际联合	6,257,202.60	2.42
28	688733	壹石通	6,076,146.62	2.35
29	002056	横店东磁	5,972,375.00	2.31
30	300079	数码视讯	5,732,963.00	2.21
31	603515	欧普照明	5,382,524.05	2.08

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。

8.4.3 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	486,838,531.68
卖出股票收入（成交）总额	490,156,606.67

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	65,874.75
2	应收证券清算款	94,153.14
3	应收股利	-
4	应收利息	2,688.25
5	应收申购款	635,456.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	798,172.97

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)

20,020	7,573.23	8,883,365.50	5.86	142,732,631.05	94.14
--------	----------	--------------	------	----------------	-------

9.2 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	7,012,019.96	4.624855

9.3 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年10月22日）基金份额总额	273,077,492.69
本报告期期初基金份额总额	136,528,754.38
本报告期基金总申购份额	165,421,952.93
减：本报告期基金总赎回份额	150,334,710.76
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	151,615,996.55

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：

1、本管理人于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：

1、中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担

任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已经连续 14 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 60,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国国际金融股份有限公司	2	217,991,789.94	22.65%	203,013.58	22.65%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	121,410,289.48	12.62%	113,070.34	12.61%	-
中信证券股份有限公司	3	55,945,920.81	5.81%	52,140.12	5.82%	本期新增1个
兴业证券股份有限公司	1	53,368,026.72	5.55%	49,701.65	5.54%	-
华西证券股份有限公司	1	52,263,127.80	5.43%	48,673.85	5.43%	-
天风证券股份有限公司	1	51,239,268.07	5.32%	47,719.33	5.32%	-
国盛证券有限责任公司	1	49,822,882.07	5.18%	46,400.59	5.18%	-
东方证券股份有限公司	3	43,507,161.86	4.52%	40,619.83	4.53%	-
国金证券股份有限公司	1	42,599,178.52	4.43%	39,671.52	4.43%	-
瑞银证券有限责任公司	1	40,583,806.81	4.22%	37,795.48	4.22%	-

申港证券股份有限公司	1	36,138,386.14	3.76%	33,655.48	3.75%	-
中信建投证券股份有限公司	2	33,996,602.20	3.53%	31,660.45	3.53%	本期新增1个
海通证券股份有限公司	1	26,838,003.41	2.79%	24,994.39	2.79%	-
招商证券股份有限公司	3	22,519,571.49	2.34%	20,972.20	2.34%	本期新增2个
中国银河证券股份有限公司	1	16,564,477.26	1.72%	15,426.02	1.72%	-
东方财富证券股份有限公司	2	15,268,926.87	1.59%	14,220.12	1.59%	-
安信证券股份有限公司	1	15,036,753.42	1.56%	14,003.74	1.56%	-
广发证券股份有限公司	1	14,454,687.55	1.50%	13,461.25	1.50%	本期新增
太平洋证券股份有限公司	1	10,927,002.18	1.14%	10,176.42	1.14%	-
华创证券有限责任公司	1	10,287,644.33	1.07%	9,580.81	1.07%	-
方正证券股份有限公司	2	7,790,506.15	0.81%	7,254.46	0.81%	-
申万宏源证券有限公司	1	4,193,868.51	0.44%	3,905.73	0.44%	-
民生证券股份有限公司	1	4,184,802.13	0.43%	3,897.69	0.43%	-
国海证券股份有限公司	1	4,103,846.48	0.43%	3,821.89	0.43%	-
国都证券股份有限公司	1	4,084,712.32	0.42%	3,804.07	0.42%	-
平安证券股份有限公司	1	2,518,006.18	0.26%	2,345.05	0.26%	-
中泰证券股份有限公司	1	1,846,948.60	0.19%	1,720.07	0.19%	本期新增
瑞信证券(中国)有限公司	2	1,830,604.00	0.19%	1,704.88	0.19%	-
长城证券股份有限公司	1	1,054,808.14	0.11%	982.40	0.11%	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	本期新增
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中航证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

a、资金实力雄厚，信誉良好；

- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定；
- 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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1,096,838.10	35.63%	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	649,601.40	21.10%	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	779,314.33	25.31%	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

中信建投证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限 公司	553,057.37	17.96%	-	-	-	-
中国银河证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
瑞信证券（中国）有 限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-

中航证券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 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	关于景顺长城公司治理混合型证券投资基金暂停接受伍佰万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告	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	2021-01-08
3	景顺长城公司治理混合型证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-11
4	关于景顺长城公司治理混合型证券投资基金限制接受拾万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-14
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
6	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
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
8	景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
9	关于景顺长城公司治理混合型证券投资基金限制接受壹佰万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-04
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-05
11	景顺长城基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-09
12	景顺长城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
13	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	2021-02-26
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12

15	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
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	2021-03-20
17	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
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-26
19	景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
20	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
21	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
22	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
23	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
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	2021-04-15
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-19
26	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
27	景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
28	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
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	2021-04-23
30	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
31	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金暂停或限制大额申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-14
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	2021-05-20
33	关于网络平台冒用“景顺长城基金”	中国证监会指定报刊及	2021-06-04

	名义进行不法活动的澄清公告	网站	
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	2021-06-15
35	景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2021 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
36	景顺长城公司治理混合型证券投资基金基金合同更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
37	景顺长城公司治理混合型证券投资基金托管协议更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
38	景顺长城基金管理有限公司关于旗下 72 只公募基金根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
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	2021-06-18
40	关于景顺长城公司治理混合型证券投资基金限制接受拾万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-30
41	关于景顺长城公司治理混合型证券投资基金限制接受壹仟元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-09
42	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	2021-07-09
43	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-13
44	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	2021-07-16
45	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	2021-07-20
46	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-21
47	景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-21
48	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	2021-07-23
49	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	2021-07-27
50	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	2021-08-06
51	关于景顺长城公司治理混合型证券投资基金新增华融证券为销售机构并开	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-16

	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		
52	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	2021-08-20
53	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-23
54	景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-23
55	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	2021-08-27
56	景顺长城基金将积极参与投资北京证券交易所上市企业	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-07
57	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	2021-10-15
58	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	2021-10-15
59	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	2021-10-22
60	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-27
61	景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-27
62	景顺长城基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金投资北交所上市股票的风险提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-16
63	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	2021-11-18
64	关于旗下部分基金参加国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	2021-11-26
65	景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2021 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-30
66	景顺长城公司治理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	2021-11-30
67	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	2021-12-03
68	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	2021-12-10
69	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在珠海盈米基金销售有限公司开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-16
70	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	2021-12-17

71	关于旗下部分基金新增泰信财富为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-24
72	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	2021-12-24
73	景顺长城基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-29

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规及本基金基金合同等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定对本基金的基金合同等法律文件进行修订，新增侧袋机制相关内容。本次修订属于法律法规规定无需召开基金份额持有人大会的事项，修订自 2021 年 6 月 18 日起正式生效。有关详细信息参见本公司于 2021 年 6 月 18 日发布的相关公告。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城公司治理股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城公司治理混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城公司治理混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城公司治理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。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 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

2022 年 3 月 28 日