

景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型 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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在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	6
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	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	21

§ 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	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	56
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	56
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	56
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	56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
8.12 投资组合报告附注	56
§ 9 基金份额持有人信息	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
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	59
§ 10 开放式基金份额变动	59
§ 11 重大事件揭示	59
11.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4 基金投资策略的改变	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8 其他重大事件	62
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 13 备查文件目录	67
13.1 备查文件目录	67
13.2 存放地点	67
13.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数
场内简称	无
基金主代码	003318
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 3 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,090,487,555.41 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资方式，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或者因法律法规限制时，或其他原因导致无法有效负责和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，对投资组合管理进行适当性变更和调整，力争降低跟踪误差。在正常情况下，本基金力争相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。</p>
业绩比较基准	95%×中证 500 行业中性低波动指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，通过跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
		胡波
		021-61618888
		Hub5@spdb.com.cn

客户服务电话	4008888606	95528
传真	0755-22381339	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 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	上海市北京东路 689 号
邮政编码	518048	200001
法定代表人	李进	郑杨

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址	www.igwfm.com
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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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	327,141,615.79	361,199,699.42	87,740,682.35
本期利润	312,235,132.45	354,859,389.57	237,611,335.89
加权平均基金份额本期利润	0.2639	0.2158	0.1589
本期加权平均净值利润率	20.41%	20.13%	17.04%
本期基金份额净值增长率	23.02%	21.20%	23.07%
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	478,732,113.42	229,457,258.38	-66,115,514.39
期末可供分配基金份额利润	0.4390	0.1697	-0.0348
期末基金资产净值	1,569,219,668.83	1,581,395,508.69	1,832,466,277.00
期末基金份额净值	1.4390	1.1697	0.9651
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	43.90%	16.97%	-3.49%

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

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

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

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

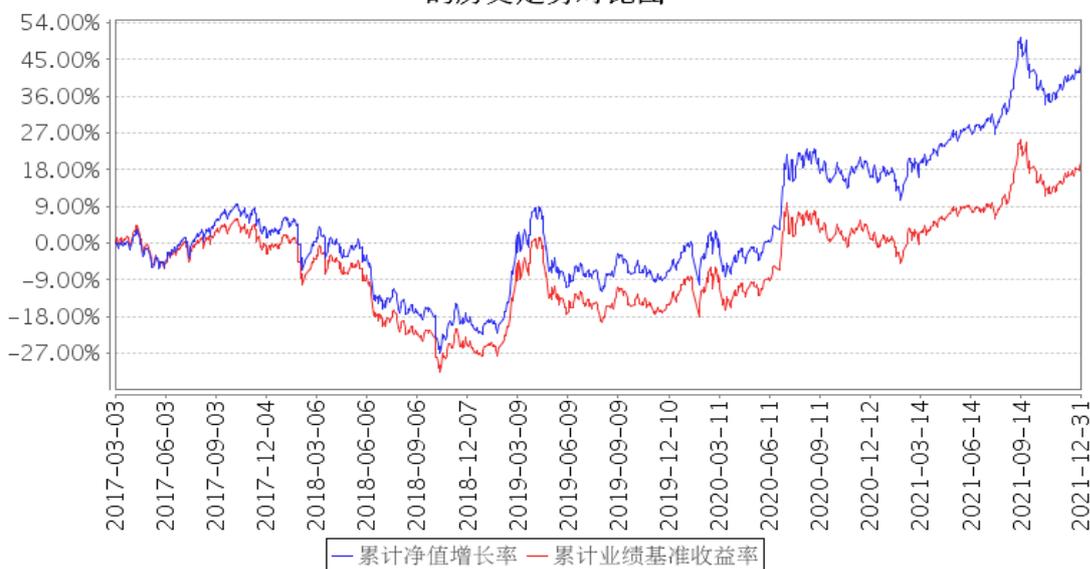
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.55%	0.69%	1.36%	0.70%	0.19%	-0.01%
过去六个月	11.49%	0.86%	10.14%	0.87%	1.35%	-0.01%
过去一年	23.02%	0.83%	19.20%	0.83%	3.82%	0.00%
过去三年	83.50%	1.17%	64.30%	1.19%	19.20%	-0.02%
自基金合同生效起至今	43.90%	1.16%	19.76%	1.16%	24.14%	0.00%

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

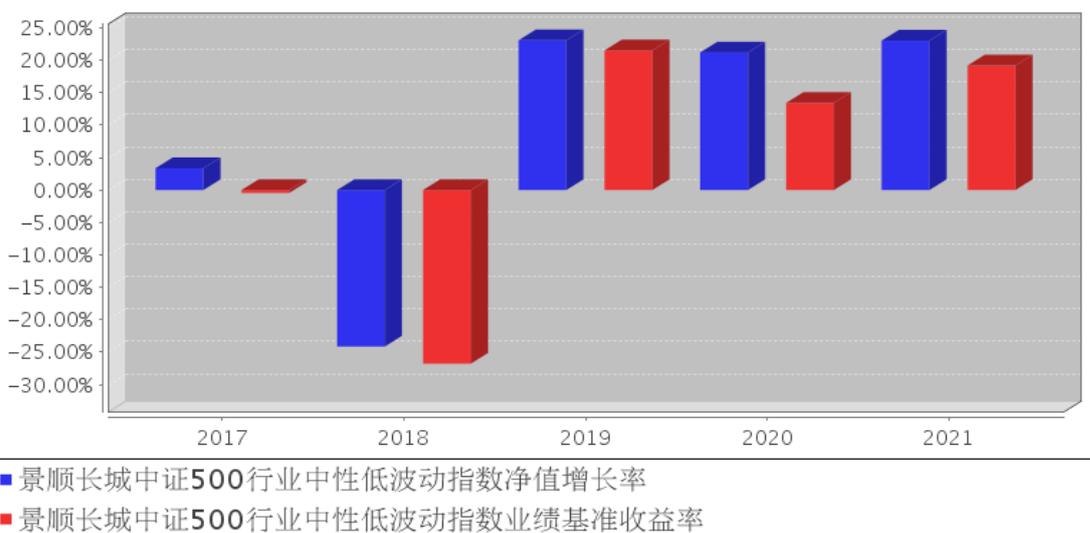
景顺长城中证500行业中性低波动指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不得低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；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，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的建仓期为自 2017 年 3 月 3 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.2.3 自基金合同生效以来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

景顺长城中证500行业中性低波动指数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



注：2017 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间为 2017 年 3 月 3 日（基金合同生

效日) 至 2017 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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		
曾理	本基金的基金经理	2019年7月16日	-	7年	工学硕士。曾任腾讯计算机系统有限公司信息安全部产品策略岗。2014年8月加入本公司，历任量化及指数投资部量化程序员、基金经理助理，自2018年10月起担任量化及指数投资部基金经理。具有7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、《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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

2021 年 12 月工业增加值当月同比增长 4.3%，前值 3.8%，出现小幅上升，政策纠偏效果开始出现。12 月 PMI 指数 50.3，小幅反弹，低于市场预期，12 月 PPI 同比增长 10.3%，环比跌 1.2%，高位回落，保供稳价政策效果逐步体现；12 月 CPI 同比增长 1.5%，前值 2.3%，环比跌 0.3%。12 月 M2 同比增速 9%，M1 同比增速 3.5%，货币供给维持偏宽松状态，社会融资规模存量同比增长 10.3%，预计未来将趋于上行。12 月末外汇储备 3.2 万亿美元，维持平稳。

一方面，非常严苛的拉闸限电限产在四季度得到纠偏，工业生产得到一定程度修复，但是仍然不够，基建投资仅小幅度改善，地产加速下滑，加上消费走弱，目前未见更多具体政策的实施，经济仍然偏弱下行压力持续加大。另一方面，宏观政策非常友好，宽货币逐步得到兑现，央行在 12 月初全面降准，结合 12 月 18 号央行“货币政策工具箱开得再大一些”、“避免信贷塌方”、“主动出击”、“靠前发力”等表述，同时在 12 月 20 号下调 5 年期 LPR 利率等，货币层面宽松信号明显。12 月的中央经济工作会议已为全年的经济目标定调：稳，未来政策友好意图非常明确，预计一二季度会有更多稳经济政策落地。

回顾全年 A 股表现，得益于光伏、新能源车产业链上中下游的突出表现，电力设备、有色金属、基础化工、汽车等行业收益率分别为 47.86%、40.47%、37.19%和 17.2%；受双碳政策大力实施，需求扩张供给不足的影响，煤炭、钢铁、石油石化等行业收益率分别为 39.6%、34.06%和 20.25%。而房地产和家用电器行业跌幅较大，分别为-11.89%和-19.54%。宽基指数表现来看，上证指数、沪深 300、中证 500、中证 1000、创业板指数以及科创 50 指数收益率分别为 4.8%、-5.2%、15.58%、20.52%、12.02%和 0.37%，呈现一定程度小市值占优的风格。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年，本基金份额净值增长率为 23.02%，业绩比较基准收益率为 19.20%。

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，A 股市场方面，未来 1-2 季度，稳增长、宽货币和宽信用是大概率方向，明年投资机会短期内可关注地产产业链相关行业和传统大基建相关行业，全年来看，看好以专精特新为代表的国产替代、智能制造相关板块个股，关注新能源产业链、半导体产业链中竞争格局好的细分环节。

本基金采用完全复制中证 500 行业中性低波动指数的方法进行组合管理，严格按照最小化跟踪偏离的策略，力争使基金收益和指数收益一致。在报告期内，本基金结合申购赎回情况，根据指数成份股及其权重变化定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

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、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

本基金本报告期内未实施利润分配。

截至本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由景顺长城基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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	安永华明（2022）审字第 60467014_H27 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	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。

	<p>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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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>其他信息</p>	<p>景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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>（1）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>（2）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>（3）评价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>(4) 对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，就可能对导致对景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资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中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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。我们与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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	昌华	黄拥璇
会计师事务所的地址	中国 北京	
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：景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金

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	100,640,138.68	94,235,694.17
结算备付金		32,607.02	-
存出保证金		49,665.39	210,281.76
交易性金融资产	7.4.7.2	1,473,624,728.71	1,494,050,292.27
其中：股票投资		1,472,203,186.51	1,494,050,292.27
基金投资		-	-
债券投资		1,421,542.20	-
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		73,313.42	799,546.48
应收利息	7.4.7.5	103,438.03	91,964.98
应收股利		-	-

应收申购款		823,260.41	1,245,690.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,575,347,151.66	1,590,633,470.47
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		3,623,927.13	6,756,127.66
应付管理人报酬		658,898.37	680,214.62
应付托管费		131,779.67	136,042.90
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,405,705.39	1,254,189.88
应交税费		3,823.35	5,876.20
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	303,348.92	405,510.52
负债合计		6,127,482.83	9,237,961.78
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,090,487,555.41	1,351,938,250.31
未分配利润	7.4.7.10	478,732,113.42	229,457,258.38
所有者权益合计		1,569,219,668.83	1,581,395,508.69
负债和所有者权益总计		1,575,347,151.66	1,590,633,470.47

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.4390 元，基金份额总额 1,090,487,555.41 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金

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		327,137,076.00	371,907,840.15
1. 利息收入		5,059,228.94	1,915,058.70
其中：存款利息收入	7.4.7.11	682,329.41	1,136,733.40
债券利息收入		380.48	838.85

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		4,376,519.05	777,486.45
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		336,388,256.92	375,148,828.62
其中：股票投资收益	7.4.7.12	306,147,032.59	345,026,272.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	198,088.42	2,118,671.25
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	30,043,135.91	28,003,884.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-14,906,483.34	-6,340,309.85
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	596,073.48	1,184,262.68
减：二、费用		14,901,943.55	17,048,450.58
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,649,763.25	8,812,472.52
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,529,952.62	1,762,494.45
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	5,170,822.01	5,883,536.40
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		15,757.92	2,801.71
7. 其他费用	7.4.7.19	535,647.75	587,145.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		312,235,132.45	354,859,389.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		312,235,132.45	354,859,389.57

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金

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)	1,351,938,250.31	229,457,258.38	1,581,395,508.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	312,235,132.45	312,235,132.45
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)	-261,450,694.90	-62,960,277.41	-324,410,972.31
其中：1. 基金申购款	380,461,908.86	117,121,351.03	497,583,259.89
2. 基金赎回款	-641,912,603.76	-180,081,628.44	-821,994,232.20
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,090,487,555.41	478,732,113.42	1,569,219,668.83
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)	1,898,581,791.39	-66,115,514.39	1,832,466,277.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	354,859,389.57	354,859,389.57
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)	-546,643,541.08	-59,286,616.80	-605,930,157.88
其中：1. 基金申购款	652,449,722.24	7,061,653.01	659,511,375.25
2. 基金赎回款	-1,199,093,263.32	-66,348,269.81	-1,265,441,533.13

回款			
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,351,938,250.31	229,457,258.38	1,581,395,508.69

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2016]1781 号文《关于准予景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金注册的批复》的核准，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《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 200,182,368.91 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 67,894.80 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 200,250,263.71 元，折合 200,250,263.71 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，登记机构为本基金管理人，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数成份股及其备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法上市的非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、银行存款、同业存单、债券、债券回购、权证、股指期货、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具以及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。

本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例不得低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；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，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，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：中证 500 行业中性低波动指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在具体会计估值核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

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

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项。

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主要包括股票、债券和衍生工具等投资。

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、结算备付金、买入返售金融资

产和其他各类应收款项等。

(2) 金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归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。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认金融资产或金融负债，按取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为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；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。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；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，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资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，按其估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用相关可观察输入值，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，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列

示：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；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

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确认。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确认，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。

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。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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、托管费和标的指数许可使用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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的相关交易费用在发生时按照确定的金额计入交易费用。

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。

其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额计入当期费用。

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 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税及附加、企业所得税

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同

业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

证券投资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，股权的股息、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）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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	100,640,138.68	94,235,694.17
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	100,640,138.68	94,235,694.17

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	1,435,152,046.42	1,472,203,186.51	37,051,140.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,421,542.20	212,542.20
	银行间市场	-	-
	合计	1,421,542.20	212,542.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,436,361,046.42	1,473,624,728.71	37,263,682.29
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	1,441,880,126.64	1,494,050,292.27	52,170,165.63
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,441,880,126.64	1,494,050,292.27	52,170,165.63

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的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	9,991.04	19,575.39
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	14.70	-
应收债券利息	270.29	-
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	93,139.60	72,294.99
其他	22.40	94.60
合计	103,438.03	91,964.98

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	1,405,705.39	1,254,189.88
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,405,705.39	1,254,189.88

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	5,077.15	13,679.15
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	220,000.00	220,000.00
应付指数使用费	78,271.77	171,831.37
合计	303,348.92	405,510.52

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	1,351,938,250.31	1,351,938,250.31
本期申购	380,461,908.86	380,461,908.86
本期赎回（以“-”号填列）	-641,912,603.76	-641,912,603.76
- 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	1,090,487,555.41	1,090,487,555.41

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	384,216,459.90	-154,759,201.52	229,457,258.38
本期利润	327,141,615.79	-14,906,483.34	312,235,132.45
本期基金份额交易产生的变动数	-95,263,155.65	32,302,878.24	-62,960,277.41
其中：基金申购款	147,179,120.06	-30,057,769.03	117,121,351.03
基金赎回款	-242,442,275.71	62,360,647.27	-180,081,628.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	616,094,920.04	-137,362,806.62	478,732,113.42

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
	活期存款利息收入	665,626.79
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	14,953.94	24,091.43
其他	1,748.68	3,684.09
合计	682,329.41	1,136,733.40

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	1,794,577,409.96	2,085,797,474.05
减：卖出股票成本总额	1,488,430,377.37	1,740,771,201.56
买卖股票差价收入	306,147,032.59	345,026,272.49

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 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	1,034,202.02	6,403,935.17
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	836,000.00	4,284,400.00
减：应收利息总额	113.60	863.92
买卖债券差价收入	198,088.42	2,118,671.25

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内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 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
股票投资产生的股利收益	30,043,135.91	28,003,884.88
其中：证券出借权益补偿收入	4,880,634.58	99,629.04
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	30,043,135.91	28,003,884.88

7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-14,906,483.34	-6,340,309.85
股票投资	-15,119,025.54	-6,340,309.85

债券投资	212,542.20	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-14,906,483.34	-6,340,309.85

7.4.7.17 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	586,311.37	1,174,142.07
基金转换费收入	9,762.11	10,120.61
合计	596,073.48	1,184,262.68

7.4.7.18 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	5,170,822.01	5,883,536.40
银行间市场交易费用	-	-
合计	5,170,822.01	5,883,536.40

7.4.7.19 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	9,657.21	14,646.59
指数使用费	305,990.54	352,498.91
合计	535,647.75	587,145.50

7.4.7.20 分部报告

截至本报告期末, 本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务, 因此, 无需作披露的分部报告。

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，本基金无需作披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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
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

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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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	7,649,763.25	8,812,472.52
其中：支付销售机构的客户维护费	3,117,504.48	3,654,077.28

注：基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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	1,529,952.62	1,762,494.45

注：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方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自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和上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行-活期	100,640,138.68	665,626.79	94,235,694.17	1,108,957.88

注：本基金的活期银行存款由基金托管人浦发银行保管，并按银行间同业利率计息。

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

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

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	644	14,193.76	36,244.32	-

景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 2021 年年度报告

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	2,064	14,365.44	25,820.64	-
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	848	78,940.32	63,888.32	-
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	704	23,344.64	17,367.68	-
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	323	11,728.13	11,472.96	-
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	409	23,754.72	20,388.65	-
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	272	21,651.20	21,360.16	-
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	599	16,658.19	18,652.86	-
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	280	16,035.60	15,038.80	-
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	1,685	20,270.55	28,847.20	-
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	1,054	63,935.64	101,974.50	-
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	253	21,773.18	23,908.50	-
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	329	12,857.32	17,150.77	-

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	779	91,049.52	90,426.32	-
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	295	12,977.05	14,977.15	-
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	435	28,788.30	24,629.70	-
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	575	16,013.75	15,789.50	-
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	402	11,770.56	12,864.00	-
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	967	24,948.60	32,539.55	-
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	280	19,569.20	24,841.60	-
688082	盛美上海	2021 年 11 月 10 日	2022 年 5 月 18 日	新股流通受限	85.00	114.28	9,337	793,645.00	1,067,032.36	-
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	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688670	金迪克	2021 年 7 月 23 日	2022 年 2 月 7 日	新股流通受限	55.18	74.11	2,310	127,465.80	171,194.10	-
688739	成大生物	2021 年 10 月 21 日	2022 年 4 月 28 日	新股流通受限	110.00	70.32	7,906	869,660.00	555,949.92	-
688768	容知日新	2021 年 7 月 16 日	2022 年 1 月 26 日	新股流通受限	18.23	108.54	907	16,534.61	98,445.78	-
688789	宏华数科	2021 年 7 月 1 日	2022 年 1 月 10 日	新股流通受限	30.28	258.86	1,400	42,392.00	362,404.00	-

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

本基金于本报告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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
1	000021	深科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	15.84	173,300	2,745,072.00
2	000028	国药一致	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	36.98	53,100	1,963,638.00
3	000050	深天马 A	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	13.02	244,000	3,176,880.00
4	000060	中金岭南	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	4.91	448,500	2,202,135.00

5	000089	深圳机场	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	7.32	165,700	1,212,924.00
6	000090	天健集团	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	5.87	373,100	2,190,097.00
7	000156	华数传媒	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	8.46	218,100	1,845,126.00
8	000400	许继电气	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	26.10	165,300	4,314,330.00
9	000401	冀东水泥	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	11.96	227,200	2,717,312.00
10	000528	柳工	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	7.71	243,300	1,875,843.00
11	000559	万向钱潮	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	6.37	304,000	1,936,480.00
12	000563	陕国投 A	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	3.23	802,200	2,591,106.00
13	000581	威孚高科	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	21.54	115,700	2,492,178.00
14	000598	兴蓉环境	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	6.32	338,600	2,139,952.00
15	000623	吉林敖东	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	18.47	122,300	2,258,881.00
16	000685	中山公用	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	8.85	230,700	2,041,695.00
17	000686	东北证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	8.78	239,200	2,100,176.00
18	000709	河钢股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	2.46	792,300	1,949,058.00
19	000728	国元证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	7.70	300,700	2,315,390.00
20	000729	燕京啤酒	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	8.47	296,500	2,511,355.00
21	000778	新兴铸管	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	4.33	582,300	2,521,359.00
22	000967	盈峰环境	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	7.33	198,900	1,457,937.00
23	000970	中科三环	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	16.05	158,500	2,543,925.00
24	000975	银泰黄金	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	8.78	248,700	2,183,586.00
25	000988	华工科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	27.86	98,300	2,738,638.00
26	000990	诚志股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	15.82	116,600	1,844,612.00
27	000997	新大陆	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	18.12	165,700	3,002,484.00
28	000999	华润三九	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	34.24	68,400	2,342,016.00
29	002028	思源电气	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	49.21	88,900	4,374,769.00
30	002038	双鹭药业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	10.81	140,700	1,520,967.00
31	002056	横店东磁	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	18.87	111,300	2,100,231.00
32	002065	东华软件	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	7.80	350,700	2,735,460.00
33	002085	万丰奥威	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	5.49	391,800	2,150,982.00
34	002110	三钢闽光	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	6.80	229,600	1,561,280.00
35	002155	湖南黄金	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	10.36	217,700	2,255,372.00
36	002156	通富微电	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	19.43	336,900	6,545,967.00
37	002185	华天科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	12.71	592,600	7,531,946.00
38	002203	海亮股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	12.43	252,600	3,139,818.00
39	002221	东华能源	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	12.59	169,800	2,137,782.00
40	002223	鱼跃医疗	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 11 日	37.80	26,600	1,005,480.00
41	002244	滨江集团	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	4.66	227,300	1,059,218.00
42	002250	联化科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	17.97	112,800	2,027,016.00
43	002281	光迅科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	23.29	108,200	2,519,978.00
44	002302	西部建设	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	8.03	364,600	2,927,738.00
45	002373	千方科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	14.95	144,100	2,154,295.00
46	002399	海普瑞	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	17.10	97,000	1,658,700.00
47	002440	闰土股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	9.59	296,000	2,838,640.00

48	002458	益生股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	11.31	160,700	1,817,517.00
49	002465	海格通信	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	10.92	252,300	2,755,116.00
50	002500	山西证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	6.60	317,500	2,095,500.00
51	002507	涪陵榨菜	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	37.80	48,900	1,848,420.00
52	002511	中顺洁柔	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	16.71	138,700	2,317,677.00
53	002595	豪迈科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	27.76	67,100	1,862,696.00
54	002690	美亚光电	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	37.46	49,200	1,843,032.00
55	002925	盈趣科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	34.03	84,400	2,872,132.00
56	002926	华西证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	9.85	219,300	2,160,105.00
57	300070	碧水源	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	7.19	200,700	1,443,033.00
58	600008	首创环保	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	3.41	505,500	1,723,755.00
59	600022	山东钢铁	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	1.79	867,100	1,552,109.00
60	600056	中国医药	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	11.81	217,300	2,566,313.00
61	600062	华润双鹤	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	13.37	228,400	3,053,708.00
62	600064	南京高科	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	9.34	130,700	1,220,738.00
63	600118	中国卫星	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	27.15	107,100	2,907,765.00
64	600126	杭钢股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	5.13	320,200	1,642,626.00
65	600153	建发股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	9.07	155,800	1,413,106.00
66	600157	永泰能源	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	1.82	1,254,800	2,283,736.00
67	600167	联美控股	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	9.01	166,700	1,501,967.00
68	600170	上海建工	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	3.60	496,000	1,785,600.00
69	600177	雅戈尔	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	6.89	192,300	1,324,947.00
70	600195	中牧股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	13.07	158,800	2,075,516.00
71	600208	新湖中宝	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	2.98	396,900	1,182,762.00
72	600266	城建发展	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	4.50	239,000	1,075,500.00
73	600271	航天信息	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	13.39	185,100	2,478,489.00
74	600282	南钢股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	3.70	433,900	1,605,430.00
75	600297	广汇汽车	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	2.67	702,100	1,874,607.00
76	600298	安琪酵母	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 11 日	60.36	24,800	1,496,928.00
77	600339	中油工程	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	3.08	799,700	2,463,076.00
78	600373	中文传媒	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	12.36	116,500	1,439,940.00
79	600377	宁沪高速	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	8.62	187,600	1,617,112.00
80	600415	小商品城	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	4.85	256,500	1,244,025.00
81	600435	北方导航	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	10.68	238,800	2,550,384.00
82	600446	金证股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	14.32	180,100	2,579,032.00
83	600482	中国动力	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	19.70	136,700	2,692,990.00
84	600487	亨通光电	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	15.12	177,600	2,685,312.00
85	600498	烽火通信	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	17.98	140,000	2,517,200.00
86	600500	中化国际	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	8.56	225,800	1,932,848.00
87	600511	国药股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 11 日	31.53	28,700	904,911.00
88	600517	国网英大	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	7.29	607,000	4,425,030.00
89	600528	中铁工业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	8.21	487,700	4,004,017.00
90	600535	天士力	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	15.85	139,500	2,211,075.00

91	600566	济川药业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	28.34	100,400	2,845,336.00
92	600567	山鹰国际	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	3.29	540,200	1,777,258.00
93	600572	康恩贝	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	5.00	465,500	2,327,500.00
94	600597	光明乳业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	14.52	134,700	1,955,844.00
95	600598	北大荒	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	14.56	144,300	2,101,008.00
96	600637	东方明珠	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	9.45	243,700	2,302,965.00
97	600642	申能股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	7.37	228,800	1,686,256.00
98	600643	爱建集团	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	6.76	164,700	1,113,372.00
99	600648	外高桥	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	13.23	67,800	896,994.00
100	600649	城投控股	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	4.11	445,300	1,830,183.00
101	600657	信达地产	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	3.73	340,800	1,271,184.00
102	600705	中航产融	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	3.97	285,500	1,133,435.00
103	600717	天津港	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	4.19	310,300	1,300,157.00
104	600718	东软集团	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	13.56	248,500	3,369,660.00
105	600728	佳都科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	8.33	294,800	2,455,684.00
106	600729	重庆百货	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	26.02	56,800	1,477,936.00
107	600754	锦江酒店	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	58.60	40,900	2,396,740.00
108	600764	中国海防	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	40.66	63,500	2,581,910.00
109	600820	隧道股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	5.38	583,700	3,140,306.00
110	600835	上海机电	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	15.92	130,500	2,077,560.00
111	600839	四川长虹	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	3.31	428,300	1,417,673.00
112	600867	通化东宝	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	10.96	167,100	1,831,416.00
113	600871	石化油服	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	2.14	1,183,600	2,532,904.00
114	600879	航天电子	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	8.24	323,600	2,666,464.00
115	600885	宏发股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	74.64	69,200	5,165,088.00
116	600901	江苏租赁	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	5.09	269,300	1,370,737.00
117	600909	华安证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	5.41	381,400	2,063,374.00
118	600928	西安银行	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	4.30	310,700	1,336,010.00
119	600959	江苏有线	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	3.29	727,600	2,393,804.00
120	600967	内蒙一机	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	11.95	272,500	3,256,375.00
121	600968	海油发展	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	2.93	959,800	2,812,214.00
122	600998	九州通	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	14.72	128,100	1,885,632.00
123	601077	渝农商行	2022 年 1 月 11 日-2022 年 1 月 12 日	3.85	259,400	998,690.00
124	601098	中南传媒	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	9.57	149,600	1,431,672.00
125	601118	海南橡胶	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	5.28	303,100	1,600,368.00
126	601179	中国西电	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	5.55	888,100	4,928,955.00
127	601228	广州港	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	3.33	371,300	1,236,429.00
128	601298	青岛港	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	5.69	205,400	1,168,726.00
129	601333	广深铁路	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	2.24	632,700	1,417,248.00
130	601718	际华集团	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	2.98	323,100	962,838.00
131	601828	美凯龙	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	8.81	157,900	1,391,099.00
132	601880	辽港股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	1.73	700,100	1,211,173.00
133	601928	凤凰传媒	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	8.09	200,000	1,618,000.00

134	601958	金钼股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	6.85	328,900	2,252,965.00
135	601992	金隅集团	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	2.84	1,242,900	3,529,836.00
136	601997	贵阳银行	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	6.51	226,500	1,474,515.00
137	603228	景旺电子	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	34.53	98,500	3,401,205.00
138	603515	欧普照明	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	20.76	58,300	1,210,308.00
139	603638	艾迪精密	2022 年 1 月 11 日-2022 年 1 月 12 日	31.92	31,200	995,904.00
140	603708	家家悦	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	16.64	70,900	1,179,776.00
141	603858	步长制药	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	21.09	91,200	1,923,408.00
142	603866	桃李面包	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	28.40	53,400	1,516,560.00
143	603868	飞科电器	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 11 日	43.42	23,900	1,037,738.00
144	688065	凯赛生物	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	184.28	10,600	1,953,368.00
合计	-	-	-	-	40,332,800	313,721,366.00

注：上述证券的出借到期日为证券实际归还日。

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 0.09%（上年度末：0.00%）。

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组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 个工作日内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 个工作日内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 2021 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	100,640,138.68	-	-	-	-	-	100,640,138.68
结算备付金	32,607.02	-	-	-	-	-	32,607.02
存出保证金	49,665.39	-	-	-	-	-	49,665.39
交易性金融资产	-	-	-	-	1,421,542.20	1,472,203,186.51	1,473,624,728.71
应收利息	-	-	-	-	-	103,438.03	103,438.03
应收申购款	-	-	-	-	-	823,260.41	823,260.41

应收证券清算款	-	-	-	-	-	73,313.42	73,313.42
资产总计	100,722,411.09	-	-	-	1,421,542.20	1,473,203,198.37	1,575,347,151.66
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,623,927.13	3,623,927.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	658,898.37	658,898.37
应付托管费	-	-	-	-	-	131,779.67	131,779.67
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,405,705.39	1,405,705.39
应交税费	-	-	-	-	-	3,823.35	3,823.35
其他负债	-	-	-	-	-	303,348.92	303,348.92
负债总计	-	-	-	-	-	6,127,482.83	6,127,482.83
利率敏感度缺口	100,722,411.09	-	-	-	1,421,542.20	-	-
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	94,235,694.17	-	-	-	-	-	94,235,694.17
存出保证金	210,281.76	-	-	-	-	-	210,281.76
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,494,050,292.27	1,494,050,292.27
应收利息	-	-	-	-	-	91,964.98	91,964.98
应收申购款	-	-	-	-	-	1,245,690.81	1,245,690.81
应收证券清算款	-	-	-	-	-	799,546.48	799,546.48
资产总计	94,445,975.93	-	-	-	-	-1,496,187,494.54	1,590,633,470.47
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,756,127.66	6,756,127.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	680,214.62	680,214.62
应付托管费	-	-	-	-	-	136,042.90	136,042.90
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,254,189.88	1,254,189.88
应交税费	-	-	-	-	-	5,876.20	5,876.20
其他负债	-	-	-	-	-	405,510.52	405,510.52
负债总计	-	-	-	-	-	9,237,961.78	9,237,961.78
利率敏感度缺口	94,445,975.93	-	-	-	-	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.09%（上年度末：0.00%），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：

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	1,472,203,186.51	93.82	1,494,050,292.27	94.48
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,472,203,186.51	93.82	1,494,050,292.27	94.48

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）		上年度末（2020年12月31日）
	本期末（2021年12月31日）		
分析	沪深 300 指数上升 5%	29,644,284.08	57,522,854.08
	沪深 300 指数下降 5%	-29,644,284.08	-57,522,854.08

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. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

2. 其他事项

(1) 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

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划分为第一层次的余额为人民币 1,469,934,855.28 元，划分为第二层次的余额为人民币 3,689,873.43 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划分为第一层次的余额为人民币 1,489,257,567.00 元，划分为第二层次的余额为人民币 4,792,725.27 元，无划分为第三层次的余额）。

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、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或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具；本基金本报告期无净转入（转出）第三层次。

(2) 根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》(财会[2017]7 号)、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》(财会[2017]8 号)、《企业会计准则第 24 号—套期会计》(财会[2017]9 号)、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(财会[2017]14 号)（以上统称新金融工具相关会计准则），以及《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会[2020]22 号)，自 2022 年 1 月 1 日起，本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

(3) 除上述事项外，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	1,472,203,186.51	93.45
	其中：股票	1,472,203,186.51	93.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,421,542.20	0.09
	其中：债券	1,421,542.20	0.09
	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	100,672,745.70	6.39
8	其他各项资产	1,049,677.25	0.07
9	合计	1,575,347,151.66	100.00

注：权益投资中参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 313,721,366.00 元，占基金资产净值的比例为 19.99%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	24,606,230.38	1.57
B	采矿业	64,657,991.96	4.12
C	制造业	859,890,752.03	54.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,665,697.11	3.23
E	建筑业	31,718,569.40	2.02
F	批发和零售业	74,041,380.88	4.72
G	交通运输、仓储和邮政业	41,043,371.53	2.62
H	住宿和餐饮业	10,782,400.00	0.69
I	信息传输、软件和信息技术服务业	93,484,044.88	5.96
J	金融业	122,701,409.75	7.82
K	房地产业	34,202,570.04	2.18
L	租赁和商务服务业	11,833,531.80	0.75
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,560,363.74	1.31
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	28,272,391.31	1.80
S	综合	-	-
	合计	1,468,460,704.81	93.58

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	3,028,264.96	0.19
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	169,480.12	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	351,324.65	0.02
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	70,990.98	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	50,198.91	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	37,932.31	0.00
S	综合	-	-
	合计	3,742,481.70	0.24

8.2.3 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

8.3.1 期末指数投资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	002185	华天科技	2,601,288	33,062,370.48	2.11
2	002156	通富微电	1,479,337	28,743,517.91	1.83
3	600885	宏发股份	311,400	23,242,896.00	1.48
4	601179	中国西电	3,986,100	22,122,855.00	1.41
5	600517	国网英大	2,725,244	19,867,028.76	1.27

6	002028	思源电气	391,200	19,250,952.00	1.23
7	000400	许继电气	726,420	18,959,562.00	1.21
8	600528	中铁工业	2,189,100	17,972,511.00	1.15
9	601992	金隅集团	5,578,900	15,844,076.00	1.01
10	603228	景旺电子	442,871	15,292,335.63	0.97
11	600718	东软集团	1,115,961	15,132,431.16	0.96
12	600967	内蒙一机	1,223,912	14,625,748.40	0.93
13	600820	隧道股份	2,619,530	14,093,071.40	0.90
14	000050	深天马 A	1,070,900	13,943,118.00	0.89
15	002203	海亮股份	1,109,200	13,787,356.00	0.88
16	600062	华润双鹤	1,026,008	13,717,726.96	0.87
17	002815	崇达技术	806,800	13,594,580.00	0.87
18	000997	新大陆	727,857	13,188,768.84	0.84
19	600118	中国卫星	481,300	13,067,295.00	0.83
20	002302	西部建设	1,601,059	12,856,503.77	0.82
21	600566	济川药业	451,224	12,787,688.16	0.81
22	002925	盈趣科技	371,133	12,629,655.99	0.80
23	600968	海油发展	4,306,100	12,616,873.00	0.80
24	002440	闰土股份	1,299,800	12,465,082.00	0.79
25	000553	安道麦 A	1,452,346	12,257,800.24	0.78
26	600482	中国动力	614,201	12,099,759.70	0.77
27	002465	海格通信	1,107,874	12,097,984.08	0.77
28	000021	深科技	761,505	12,062,239.20	0.77
29	600487	亨通光电	797,600	12,059,712.00	0.77
30	000988	华工科技	432,000	12,035,520.00	0.77
31	002065	东华软件	1,539,300	12,006,540.00	0.77
32	600879	航天电子	1,452,500	11,968,600.00	0.76
33	000401	冀东水泥	999,500	11,954,020.00	0.76
34	600764	中国海防	285,300	11,600,298.00	0.74
35	600446	金证股份	808,769	11,581,572.08	0.74
36	600056	中国医药	975,988	11,526,418.28	0.73
37	600435	北方导航	1,072,690	11,456,329.20	0.73
38	000563	陕国投 A	3,522,418	11,377,410.14	0.73
39	600871	石化油服	5,312,300	11,368,322.00	0.72
40	600498	烽火通信	629,186	11,312,764.28	0.72
41	000970	中科三环	696,300	11,175,615.00	0.71
42	600271	航天信息	831,500	11,133,785.00	0.71
43	002281	光迅科技	475,500	11,074,395.00	0.71
44	000778	新兴铸管	2,556,536	11,069,800.88	0.71
45	601568	北元集团	1,359,900	11,055,987.00	0.70
46	600339	中油工程	3,589,000	11,054,120.00	0.70
47	600728	佳都科技	1,323,500	11,024,755.00	0.70

48	000729	燕京啤酒	1,301,400	11,022,858.00	0.70
49	000581	威孚高科	508,575	10,954,705.50	0.70
50	600754	锦江酒店	184,000	10,782,400.00	0.69
51	600959	江苏有线	3,265,820	10,744,547.80	0.68
52	600572	康恩贝	2,090,046	10,450,230.00	0.67
53	600637	东方明珠	1,094,400	10,342,080.00	0.66
54	000999	华润三九	300,808	10,299,665.92	0.66
55	600157	永泰能源	5,631,400	10,249,148.00	0.65
56	002511	中顺洁柔	609,171	10,179,247.41	0.65
57	000728	国元证券	1,320,600	10,168,620.00	0.65
58	601958	金钼股份	1,476,720	10,115,532.00	0.64
59	000623	吉林敖东	537,720	9,931,688.40	0.63
60	600535	天士力	626,568	9,931,102.80	0.63
61	002155	湖南黄金	956,236	9,906,604.96	0.63
62	000060	中金岭南	1,969,100	9,668,281.00	0.62
63	000090	天健集团	1,637,400	9,611,538.00	0.61
64	000975	银泰黄金	1,093,000	9,596,540.00	0.61
65	002926	华西证券	964,100	9,496,385.00	0.61
66	002373	千方科技	633,000	9,463,350.00	0.60
67	002085	万丰奥威	1,720,012	9,442,865.88	0.60
68	600598	北大荒	648,064	9,435,811.84	0.60
69	000598	兴蓉环境	1,486,600	9,395,312.00	0.60
70	002221	东华能源	746,200	9,394,658.00	0.60
71	600835	上海机电	586,180	9,331,985.60	0.59
72	600195	中牧股份	713,516	9,325,654.12	0.59
73	600597	光明乳业	641,500	9,314,580.00	0.59
74	600909	华安证券	1,711,271	9,257,976.11	0.59
75	002056	横店东磁	489,112	9,229,543.44	0.59
76	000686	东北证券	1,050,733	9,225,435.74	0.59
77	002500	山西证券	1,393,464	9,196,862.40	0.59
78	601077	渝农商行	2,355,100	9,067,135.00	0.58
79	603638	艾迪精密	283,900	9,062,088.00	0.58
80	000685	中山公用	1,013,200	8,966,820.00	0.57
81	002250	联化科技	495,593	8,905,806.21	0.57
82	688065	凯赛生物	48,241	8,889,851.48	0.57
83	600500	中化国际	1,013,710	8,677,357.60	0.55
84	603858	步长制药	410,058	8,648,123.22	0.55
85	000028	国药一致	233,800	8,645,924.00	0.55
86	000709	河钢股份	3,476,219	8,551,498.74	0.54
87	000559	万向钱潮	1,335,171	8,505,039.27	0.54
88	600998	九州通	575,600	8,472,832.00	0.54
89	600297	广汇汽车	3,151,500	8,414,505.00	0.54

90	000528	柳工	1,068,620	8,239,060.20	0.53
91	600867	通化东宝	750,226	8,222,476.96	0.52
92	600649	城投控股	1,998,878	8,215,388.58	0.52
93	002595	豪迈科技	295,600	8,205,856.00	0.52
94	002507	涪陵榨菜	215,500	8,145,900.00	0.52
95	000156	华数传媒	958,000	8,104,680.00	0.52
96	000990	诚志股份	512,200	8,103,004.00	0.52
97	002690	美亚光电	216,300	8,102,598.00	0.52
98	002831	裕同科技	238,500	8,035,065.00	0.51
99	600170	上海建工	2,226,100	8,013,960.00	0.51
100	002458	益生股份	706,234	7,987,506.54	0.51
101	600567	山鹰国际	2,424,900	7,977,921.00	0.51
102	600298	安琪酵母	131,800	7,955,448.00	0.51
103	601200	上海环境	620,986	7,818,213.74	0.50
104	600008	首创环保	2,268,900	7,736,949.00	0.49
105	600642	申能股份	1,027,683	7,574,023.71	0.48
106	600126	杭钢股份	1,438,500	7,379,505.00	0.47
107	002399	海普瑞	426,500	7,293,150.00	0.46
108	601928	凤凰传媒	898,000	7,264,820.00	0.46
109	600377	宁沪高速	842,100	7,258,902.00	0.46
110	600282	南钢股份	1,947,700	7,206,490.00	0.46
111	601118	海南橡胶	1,360,400	7,182,912.00	0.46
112	600022	山东钢铁	3,890,140	6,963,350.60	0.44
113	002110	三钢闽光	1,009,300	6,863,240.00	0.44
114	603866	桃李面包	240,056	6,817,590.40	0.43
115	600167	联美控股	748,440	6,743,444.40	0.43
116	002038	双鹭药业	618,000	6,680,580.00	0.43
117	600729	重庆百货	255,573	6,650,009.46	0.42
118	601997	贵阳银行	1,017,960	6,626,919.60	0.42
119	600373	中文传媒	524,400	6,481,584.00	0.41
120	601098	中南传媒	670,983	6,421,307.31	0.41
121	000967	盈峰环境	873,300	6,401,289.00	0.41
122	600839	四川长虹	1,923,300	6,366,123.00	0.41
123	601333	广深铁路	2,841,500	6,364,960.00	0.41
124	600153	建发股份	699,706	6,346,333.42	0.40
125	300070	碧水源	881,900	6,340,861.00	0.40
126	601828	美凯龙	709,280	6,248,756.80	0.40
127	002966	苏州银行	913,200	6,182,364.00	0.39
128	600901	江苏租赁	1,208,200	6,149,738.00	0.39
129	600928	西安银行	1,393,500	5,992,050.00	0.38
130	600177	雅戈尔	863,900	5,952,271.00	0.38
131	600717	天津港	1,394,378	5,842,443.82	0.37

132	600657	信达地产	1,530,900	5,710,257.00	0.36
133	600415	小商品城	1,151,500	5,584,775.00	0.36
134	601228	广州港	1,668,187	5,555,062.71	0.35
135	002223	鱼跃医疗	146,108	5,522,882.40	0.35
136	600064	南京高科	588,069	5,492,564.46	0.35
137	603515	欧普照明	263,100	5,461,956.00	0.35
138	601880	辽港股份	3,143,400	5,438,082.00	0.35
139	603868	飞科电器	123,600	5,366,712.00	0.34
140	000089	深圳机场	728,500	5,332,620.00	0.34
141	603708	家家悦	319,048	5,308,958.72	0.34
142	600208	新湖中宝	1,781,200	5,307,976.00	0.34
143	601298	青岛港	922,900	5,251,301.00	0.33
144	600511	国药股份	166,400	5,246,592.00	0.33
145	600705	中航产融	1,282,900	5,093,113.00	0.32
146	600643	爱建集团	739,700	5,000,372.00	0.32
147	600266	城建发展	1,073,000	4,828,500.00	0.31
148	002244	滨江集团	997,400	4,647,884.00	0.30
149	601718	际华集团	1,452,000	4,326,960.00	0.28
150	600648	外高桥	305,000	4,035,150.00	0.26

8.3.2 期末积极投资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	688082	盛美上海	9,337	1,067,032.36	0.07
2	688739	成大生物	7,906	555,949.92	0.04
3	688789	宏华数科	1,400	362,404.00	0.02
4	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.02
5	688670	金迪克	2,310	171,194.10	0.01
6	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.01
7	688768	容知日新	907	98,445.78	0.01
8	301177	迪阿股份	779	90,426.32	0.01
9	301087	可孚医疗	848	63,888.32	0.00
10	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
11	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
12	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
13	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
14	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
15	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
16	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
17	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
18	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
19	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00

20	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
21	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
22	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
23	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
24	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
25	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
26	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
27	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
28	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
29	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
30	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
31	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
32	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
33	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
34	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
35	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
36	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
37	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
38	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
39	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
40	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
41	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
42	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
43	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
44	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
45	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
46	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
47	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
48	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
49	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
50	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
51	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
52	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
53	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
54	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
55	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
56	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
57	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
58	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
59	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
60	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
61	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
62	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00

63	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
64	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
65	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
66	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
67	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
68	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
69	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
70	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
71	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
72	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
73	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
74	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
75	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
76	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
77	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	002185	华天科技	35,873,887.29	2.27
2	002156	通富微电	30,597,767.80	1.93
3	600885	宏发股份	23,265,066.75	1.47
4	601179	中国西电	20,466,927.00	1.29
5	600517	国网英大	20,274,535.20	1.28
6	002028	思源电气	19,641,829.00	1.24
7	000400	许继电气	18,970,711.40	1.20
8	601868	中国能建	17,284,582.00	1.09
9	300482	万孚生物	16,341,189.68	1.03
10	000553	安道麦 A	15,314,222.60	0.97
11	002458	益生股份	14,121,507.76	0.89
12	002302	西部建设	13,860,094.75	0.88
13	000401	冀东水泥	13,807,052.00	0.87
14	600967	内蒙一机	13,566,274.16	0.86
15	002180	纳思达	13,512,196.00	0.85
16	600598	北大荒	13,421,916.08	0.85
17	002065	东华软件	13,349,607.00	0.84
18	601568	北元集团	12,996,400.00	0.82
19	600271	航天信息	12,818,173.00	0.81
20	002925	盈趣科技	12,730,984.73	0.81

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	600460	士兰微	26,235,313.36	1.66
2	600673	东阳光	25,325,661.81	1.60
3	600171	上海贝岭	24,105,879.00	1.52
4	002180	纳思达	23,156,177.00	1.46
5	600039	四川路桥	22,974,115.00	1.45
6	002268	卫士通	22,959,574.00	1.45
7	000825	太钢不锈	21,081,144.21	1.33
8	600623	华谊集团	20,956,487.76	1.33
9	601868	中国能建	19,914,128.95	1.26
10	000301	东方盛虹	19,564,505.78	1.24
11	600256	广汇能源	19,110,004.80	1.21
12	601117	中国化学	19,011,020.00	1.20
13	002223	鱼跃医疗	18,318,327.00	1.16
14	603225	新风鸣	18,179,885.12	1.15
15	300244	迪安诊断	17,656,506.30	1.12
16	002434	万里扬	17,513,346.76	1.11
17	601966	玲珑轮胎	17,280,504.57	1.09
18	600170	上海建工	16,936,732.00	1.07
19	603379	三美股份	16,361,492.56	1.03
20	601106	中国一重	16,172,789.00	1.02

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	1,481,702,297.15
卖出股票收入（成交）总额	1,794,577,409.96

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

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）	1,421,542.20	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,421,542.20	0.09

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

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	110083	苏租转债	12,090	1,421,542.20	0.09

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率和交易成本。

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

1、通富微电子股份有限公司（以下简称“通富微电”，股票代码：002156）于 2021 年 1 月

28 日收到中华人民共和国上海浦东国际机场海关出具的行政处罚决定（沪浦机关缉违字[2021]0015 号），其因委托上海伟奕国际货运代理有限公司，申报的进口货物数量与实际进口数量不符，构成违反海关监管规定的行为，被处罚款共计人民币 20000 元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对通富微电进行了投资。

2、深圳市景旺电子股份有限公司（以下简称“景旺电子”，股票代码：603228），于 2021 年 9 月 9 日收到深圳市交通运输局出具的行政处罚决定（深交罚决第 ZD102306 号），其因位未经审批同意开设路口的违法行为，违反了《深圳经济特区道路交通安全管理条例》第一百一十一条，被处以罚款捌万元整（80000 元）。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对景旺电子进行了投资。

3、其余八名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	49,665.39
2	应收证券清算款	73,313.42
3	应收股利	-
4	应收利息	103,438.03
5	应收申购款	823,260.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,049,677.25

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002185	华天科技	7,531,946.00	0.48	转融通流通受限
2	002156	通富微电	6,545,967.00	0.42	转融通流通受限
3	600885	宏发股份	5,165,088.00	0.33	转融通流通受限
4	601179	中国西电	4,928,955.00	0.31	转融通流通受限
5	600517	国网英大	4,425,030.00	0.28	转融通流通受限
6	002028	思源电气	4,374,769.00	0.28	转融通流通受限
7	000400	许继电气	4,314,330.00	0.27	转融通流通受限
8	600528	中铁工业	4,004,017.00	0.26	转融通流通受限
9	601992	金隅集团	3,529,836.00	0.22	转融通流通受限
10	603228	景旺电子	3,401,205.00	0.22	转融通流通受限

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688082	盛美上海	1,067,032.36	0.07	新股流通受限
2	688739	成大生物	555,949.92	0.04	新股流通受限
3	688789	宏华数科	362,404.00	0.02	新股流通受限
4	688262	国芯科技	299,275.42	0.02	新股流通受限
5	688670	金迪克	171,194.10	0.01	新股流通受限

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 (%)
124,959	8,726.76	34,068,308.07	3.12	1,056,419,247.34	96.88

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	11,041.45	0.001013

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

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。

9.4 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（2017 年 3 月 3 日）基金份额总额	200,250,263.71
本报告期期初基金份额总额	1,351,938,250.31
本报告期基金总申购份额	380,461,908.86
减：本报告期基金总赎回份额	641,912,603.76
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	1,090,487,555.41

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：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本基金聘请的安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 5 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 100,000.00 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	
招商证券股份有限公司	2	3,211,390,307.45	100.00%	2,990,782.40	100.00%	-
长城证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期新增
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
开源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增

中泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	本期 新增
中信建投 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。

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
招商证券 股份有限 公司	1,034,202.02	100.00%	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
开源证券股份有限公司						
信达证券股份有限公司						
中泰证券股份有限公司						
中信建投证券股份有限公司						

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	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	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金 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	关于景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金新增华泰证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、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	2021-02-24
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-25
10	关于旗下部分基金新增中欧财富为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-09

11	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
12	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
13	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-20
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部分公募基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》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	2021-03-29
17	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
18	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
19	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金 2021 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
20	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金基金合同（基金合同更新）	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
21	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
22	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
23	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
24	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
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	2021-04-15
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	2021-04-19
27	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
28	景顺长城中证 500 行业中性低波动指	中国证监会指定报刊及	2021-04-22

	数型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	网站	
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
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	2021-05-12
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”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
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	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金 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
36	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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系统停机维护的公告	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	2021-07-09
40	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
41	关于旗下部分基金新增挖财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、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-14
42	关于景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金在长量基金开通基金定期定额投资业务及参加申购、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	2021-07-16
43	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-16
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	2021-07-20
45	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
46	景顺长城中证 500 行业中性低波动指	中国证监会指定报刊及	2021-07-21

	数型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	网站	
47	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
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	2021-07-27
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	2021-08-06
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	2021-08-20
51	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
52	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-23
53	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
54	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
55	关于景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金新增申万宏源西部证券有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、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	2021-09-22
56	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承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	2021-09-30
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	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金 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	中国证监会指定报刊及	2021-11-18

	停机维护的公告	网站	
64	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金 2021 年第 3 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-30
65	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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
66	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
67	关于旗下部分基金新增招商银行为销售机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-09
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

1、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。

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运作指引第 3 号-指数基金指引》等法律法规及各基金基金合同、招募说明书及其更新等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，我司对旗下包括本基金在内的 15 只基金的基金合同等法律文件进行修订。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 3 月 29 日起正式生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2021 年 3 月 29 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分公募基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引〉修改基金合同等法律文件的公告》。

§ 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中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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