

景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	12
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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	20

§ 8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	70
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	70
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	70
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	70
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
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	71
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	72
§ 10 开放式基金份额变动	72
§ 11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
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	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
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	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	77
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	81
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	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	82
§ 13 备查文件目录	82
13.1 备查文件目录	82
13.2 存放地点	82
13.3 查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城量化小盘股票
场内简称	无
基金主代码	005457
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月6日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	381,481,082.93份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	李申
	联系电话	0755-82370388	021-60637102

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金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	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	60,724,703.83	86,373,902.12	64,536,427.03
本期利润	72,670,568.84	74,458,900.75	120,838,127.85
加权平均基金份额本期利润	0.3689	0.4242	0.2687
本期加权平均净值利润率	21.90%	37.20%	28.69%
本期基金份额净值增长率	31.98%	42.45%	26.29%
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	319,030,729.85	39,194,995.42	-8,661,877.41
期末可供分配基金份额利润	0.8363	0.3913	-0.0233
期末基金资产净值	700,511,812.78	139,357,127.13	363,520,500.88
期末基金份额净值	1.8362	1.3913	0.9767
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	83.62%	39.13%	-2.33%

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。

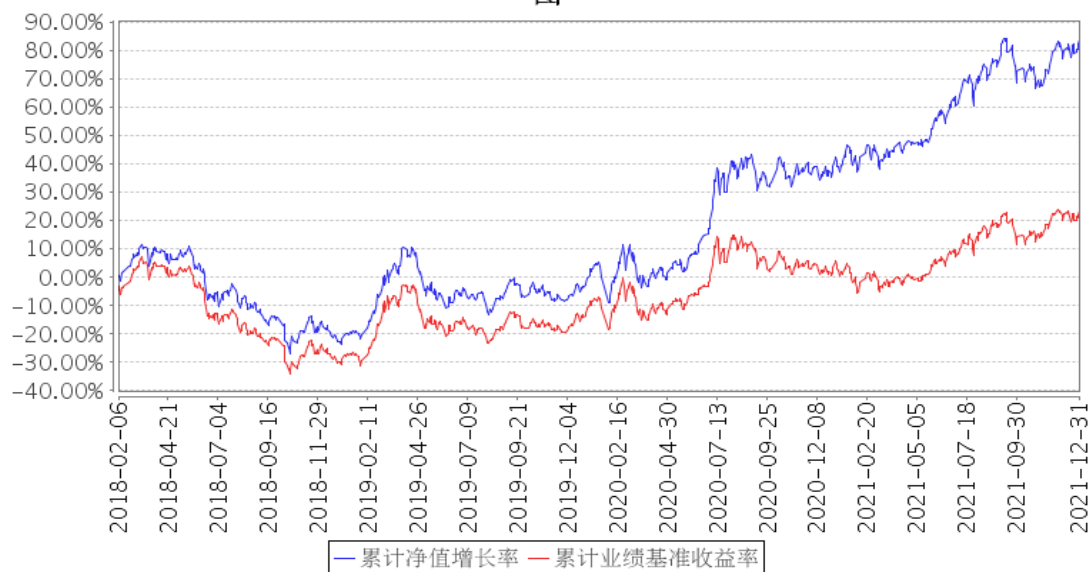
3.2 基金净值表现

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	6.32%	0.98%	7.77%	1.00%	-1.45%	-0.02%
过去六个月	12.05%	1.14%	12.45%	1.19%	-0.40%	-0.05%
过去一年	31.98%	1.08%	19.52%	1.15%	12.46%	-0.07%
过去三年	137.42%	1.41%	76.35%	1.44%	61.07%	-0.03%
自基金合同生效起至今	83.62%	1.45%	23.39%	1.46%	60.23%	-0.01%

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

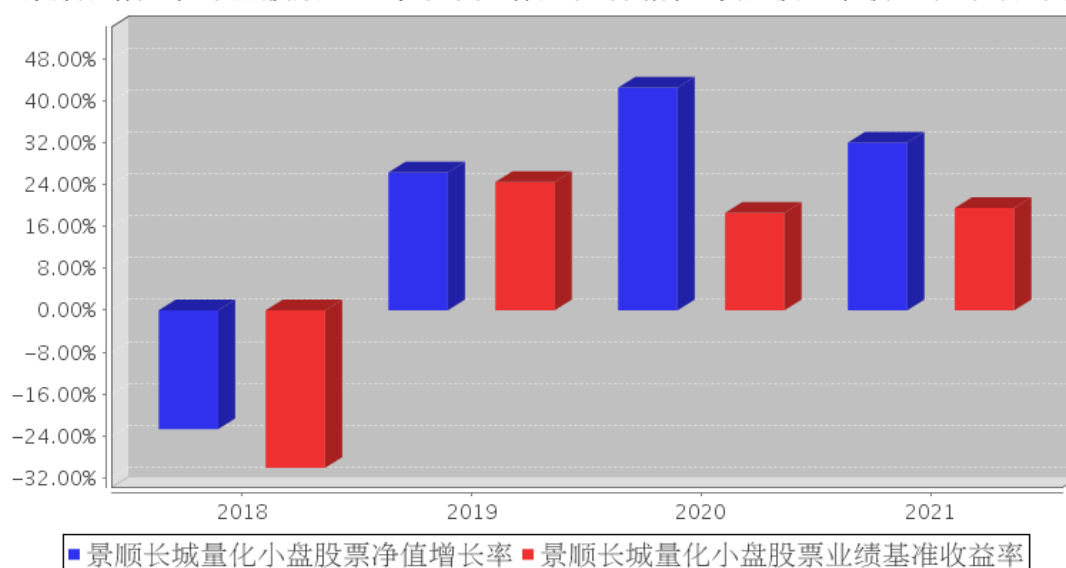
景顺长城量化小盘股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

3.2.3 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

景顺长城量化小盘股票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：2018 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2018 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2018 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		
黎海威	本基金的基金经理	2018 年 2 月 6 日	-	18 年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有 18 年海内外证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公
第 9 页 共 82 页

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、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

所有投资对象的投资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，受出口超预期增长、新动能不断增强和上半年低基数等因素的影响，中国经济稳定回升，全年呈现前高后低走势。全年 GDP 增长 8.1%，工业增加值累计增长 9.6%。12 月 PMI 指数 50.3，景气指数企稳回升。12 月 PPI 同比上涨 10.3%，环比下降 2.6%；12 月 CPI 同比上涨 1.5%，环比下降 0.8%。12 月 M2 同比增速 9%，M1 同比增速 3.5%，全年社会融资规模存量同比增长 10.29%。12 月末外汇储备 3.25 万亿美元，汇率保持基本稳定。

2021 年上半年，超预期强势的出口和极具韧性的房地产投资对经济形成有力支撑。下半年以来，出口以及房地产投资的情况均出现了明显变化，经济面临一定的下行压力。受疫情持续反复及居民收入增长乏力等因素影响，国内消费疲弱，12 月社会消费品零售总额同比增长 1.7%，增速尚未恢复到疫情前水平。信用环境仍偏弱，政策层面宽信用的意图比较明确，货币政策方面也通过全面降准、多种结构性工具进行配合。2021 年全年 A 股市场呈现出结构性分化行情，沪深 300 指数下跌 5.2%，中证 500 和创业板指分别上涨 15.58%、12.02%。

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 31.98%，业绩比较基准收益率为 19.52%。

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，海外流动性拐点临近、通胀压力仍在，外需大概率将走弱，需要警惕美股波动以及美元走高对于新兴市场的冲击。国内经济可能要面临内外需同时走弱风险，经济扩张动能减弱的趋势或将维持。PPI-CPI 的剪刀差将明显收窄，中下游盈利能力有望得到边际修复。为了稳定增长，货币、信用进入新一轮宽松周期，但预计整体扩张力度较温和，信用分化、结构性扩张的格局将延续。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。权益市场仍具备结构性配置机会，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。我们的投资组合仍然会维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生长期投资回报。

4.6 管理人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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金

法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

本报告期内，本基金未实施利润分配。

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

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

§ 6 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 24483 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	景顺长城量化小盘股票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量化小盘股票型证券投资基金(以下简称“景顺长城量化小盘基金”)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量化小盘基金 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量</p>

	化小盘基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>景顺长城量化小盘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量化小盘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量化小盘基金、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量化小盘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，就可能对景顺长城量化小盘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量化小盘基金不能持续经营。</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</p>

	的值得关注的内部控制缺陷。	
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：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

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	82,491,581.55	9,728,732.65
结算备付金		4,201,935.28	550,625.42
存出保证金		130,491.44	42,642.36
交易性金融资产	7.4.7.2	652,780,759.73	130,519,259.84
其中：股票投资		652,422,359.73	130,519,259.84
基金投资		-	-
债券投资		358,400.00	-
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		-	168,282.69
应收利息	7.4.7.5	6,603.93	1,223.81
应收股利		-	-
应收申购款		1,917,503.64	36,479.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		741,528,875.57	141,047,245.95
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		34,080,529.04	-
应付赎回款		2,978,264.43	884,996.60
应付管理人报酬		846,890.40	180,624.45

应付托管费		141,148.38	30,104.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,788,434.36	419,006.12
应交税费		2.21	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	181,793.97	175,387.58
负债合计		41,017,062.79	1,690,118.82
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	381,481,082.93	100,162,131.71
未分配利润	7.4.7.10	319,030,729.85	39,194,995.42
所有者权益合计		700,511,812.78	139,357,127.13
负债和所有者权益总计		741,528,875.57	141,047,245.95

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.8362 元，基金份额总额 381,481,082.93 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 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		87,101,459.45	81,900,235.95
1. 利息收入		123,123.62	106,619.39
其中：存款利息收入	7.4.7.11	122,907.78	106,546.87
债券利息收入		215.84	72.52
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）		73,863,919.74	93,386,565.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	71,512,323.10	91,336,491.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	100,656.65	155,446.97
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	2,250,939.99	1,894,626.52
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	11,945,865.01	-11,915,001.37
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	1,168,551.08	322,052.93
减：二、费用		14,430,890.61	7,441,335.20
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,953,051.66	3,040,642.13
2. 托管费	7.4.10.2.2	825,508.62	506,773.80
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	8,467,586.41	3,708,465.34
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.67	0.27
7. 其他费用	7.4.7.19	184,743.25	185,453.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		72,670,568.84	74,458,900.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		72,670,568.84	74,458,900.75

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 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）	100,162,131.71	39,194,995.42	139,357,127.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	72,670,568.84	72,670,568.84
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）	281,318,951.22	207,165,165.59	488,484,116.81
其中：1. 基金申购款	493,938,059.34	352,687,038.00	846,625,097.34
2. 基金赎回款	-212,619,108.12	-145,521,872.41	-358,140,980.53

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)	381,481,082.93	319,030,729.85	700,511,812.78
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)	372,182,378.29	-8,661,877.41	363,520,500.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	74,458,900.75	74,458,900.75
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)	-272,020,246.58	-26,602,027.92	-298,622,274.50
其中：1. 基金申购款	59,653,686.71	9,640,133.50	69,293,820.21
2. 基金赎回款	-331,673,933.29	-36,242,161.42	-367,916,094.71
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)	100,162,131.71	39,194,995.42	139,357,127.13

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

景顺长城量化小盘股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]第 2169 号《关于准予景顺长城量化小盘股票型证券投资基金注册的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,783,703,963.03 元,业经普华

永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0090 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,784,551,427.10 份基金份额,其中认购资金利息折合 847,464.07 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债等)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为 80-95%,投资于小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%,除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-20%,每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需要缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府证券不低于基金净资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率 X95%+银行活期存款利率(税后)X5%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 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。

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

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

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

对基金通过沪港通或深港通(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	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	82,491,581.55	9,728,732.65
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	82,491,581.55	9,728,732.65

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	642,341,687.77	652,422,359.73	10,080,671.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	358,400.00	102,400.00
	银行间市场	-	-
	合计	358,400.00	102,400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	642,597,687.77	652,780,759.73	10,183,071.96

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	132,282,052.89	130,519,259.84	-1,762,793.05
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	132,282,052.89	130,519,259.84	-1,762,793.05

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	4,617.30	956.81
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	1,890.90	247.80
应收债券利息	37.03	-
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	58.70	19.20
合计	6,603.93	1,223.81

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	2,788,434.36	419,006.12
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,788,434.36	419,006.12

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	6,793.97	387.58
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	175,000.00	175,000.00
合计	181,793.97	175,387.58

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	100,162,131.71	100,162,131.71
本期申购	493,938,059.34	493,938,059.34
本期赎回（以“-”号填列）	-212,619,108.12	-212,619,108.12
- 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	381,481,082.93	381,481,082.93

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	58,855,331.16	-19,660,335.74	39,194,995.42
本期利润	60,724,703.83	11,945,865.01	72,670,568.84
本期基金份额交易产生的变动数	231,382,183.65	-24,217,018.06	207,165,165.59
其中：基金申购款	400,604,084.00	-47,917,046.00	352,687,038.00
基金赎回款	-169,221,900.35	23,700,027.94	-145,521,872.41

本期已分配利润	-	-	-
本期末	350,962,218.64	-31,931,488.79	319,030,729.85

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	88,336.46	92,550.62
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	33,739.24	12,811.00
其他	832.08	1,185.25
合计	122,907.78	106,546.87

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	2,628,515,814.92	1,305,422,135.65
减：卖出股票成本总额	2,557,003,491.82	1,214,085,644.14
买卖股票差价收入	71,512,323.10	91,336,491.51

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	514,340.84	576,421.66
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	413,500.00	420,900.00
减：应收利息总额	184.19	74.69
买卖债券差价收入	100,656.65	155,446.97

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 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	2,250,939.99	1,894,626.52

益		
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	2,250,939.99	1,894,626.52

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	11,945,865.01	-11,915,001.37
股票投资	11,843,465.01	-11,915,001.37
债券投资	102,400.00	-
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	11,945,865.01	-11,915,001.37

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	1,092,985.05	308,395.79
基金转换费收入	75,566.03	13,657.14
合计	1,168,551.08	322,052.93

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	8,467,586.41	3,708,465.34
银行间市场交易费用	-	-
合计	8,467,586.41	3,708,465.34

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	55,000.00	55,000.00
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	9,383.25	10,093.66
其他	360.00	360.00
合计	184,743.25	185,453.66

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

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	占当期股票成交总额的比例 (%)	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	占当期股票成交总额的比例 (%)
长城证券	75,280,696.07	1.33	21,386,770.50	0.93

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	70,107.94	1.33	-	-
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	19,917.62	0.93	18,985.69	4.53

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	4,953,051.66
其中：支付销售机构的客户维护费	1,628,013.02	1,378,183.37

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 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托管费	825,508.62

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 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
中国建设银行-活期	82,491,581.55	88,336.46	9,728,732.65	92,550.62

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

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

本基金本报告期内无利润分配。

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	455	6,433.70	40,890.85	-
301030	仕净	2021年	2022年	新股流	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-

	科技	7月15日	1月24日	通受限						
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	249	5,487.96	14,013.72	-
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	754	5,247.84	9,432.54	-
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	385	35,839.65	29,005.90	-
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	681	22,581.96	16,800.27	-
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	401	23,290.08	19,989.85	-

		日	日								
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	234	18,626.40	18,376.02		-
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	457	27,721.62	44,214.75		-
301166	优宁	2021年	2022年	新股流	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50		-

	维	12月21日	6月28日	通受限						
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	350	40,908.00	40,628.00	-
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	-
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	5,968	250,536.64	250,536.64	-

688296	和达科技	2021年 7月19 日	2022年 1月27 日	新股流 通受限	12.46	49.67	2,173	27,075.58	107,932.91	-
688501	青达环保	2021年 7月9 日	2022年 1月17 日	新股流 通受限	10.57	21.11	1,759	18,592.63	37,132.49	-
688800	瑞可达	2021年 7月14 日	2022年 1月24 日	新股流 通受限	15.02	133.53	1,967	29,544.34	262,653.51	-

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 0.05%（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的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

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

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

规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	82,491,581.55	-	-	-	-	-	82,491,581.55
结算备付金	4,201,935.28	-	-	-	-	-	4,201,935.28
存出保证金	130,491.44	-	-	-	-	-	130,491.44
交易性金融资产	-	-	-	-	358,400.00	652,422,359.73	652,780,759.73
应收利息	-	-	-	-	-	6,603.93	6,603.93
应收申购款	-	-	-	-	-	1,917,503.64	1,917,503.64
资产总计	86,824,008.27	-	-	-	358,400.00	654,346,467.30	741,528,875.57
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,978,264.43	2,978,264.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	846,890.40	846,890.40
应付托管费	-	-	-	-	-	141,148.38	141,148.38
应付证券清算款	-	-	-	-	-	34,080,529.04	34,080,529.04
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,788,434.36	2,788,434.36
应交税费	-	-	-	-	-	2.21	2.21
其他负债	-	-	-	-	-	181,793.97	181,793.97
负债总计	-	-	-	-	-	41,017,062.79	41,017,062.79
利率敏感度缺口	86,824,008.27	-	-	-	358,400.00	-	-
上年度末 2020 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	9,728,732.65	-	-	-	-	-	9,728,732.65
结算备付金	550,625.42	-	-	-	-	-	550,625.42
存出保证金	42,642.36	-	-	-	-	-	42,642.36
交易性金融资产	-	-	-	-	-	130,519,259.84	130,519,259.84
应收利息	-	-	-	-	-	1,223.81	1,223.81
应收申购款	-	-	-	-	-	36,479.18	36,479.18
应收证券清算款	-	-	-	-	-	168,282.69	168,282.69
资产总计	10,322,000.43	-	-	-	-	130,725,245.52	141,047,245.95
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	884,996.60	884,996.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	180,624.45	180,624.45
应付托管费	-	-	-	-	-	30,104.07	30,104.07
应付交易费用	-	-	-	-	-	419,006.12	419,006.12
其他负债	-	-	-	-	-	175,387.58	175,387.58
负债总计	-	-	-	-	-	1,690,118.82	1,690,118.82
利率敏感度缺口	10,322,000.43	-	-	-	-	-	-

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 0.05%（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	652,422,359.73	93.14	130,519,259.84	93.66
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	652,422,359.73	93.14	130,519,259.84	93.66

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%	23,250,104.75	6,946,974.22
	沪深 300 指数下降 5%	-23,250,104.75	-6,946,974.22

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 651,172,570.96 元，属于第二层次的余额为 1,608,188.77 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 127,454,034.53 元，第二层次 3,065,225.31 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—金融工具确认和计量》、《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》,公募基金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	652,422,359.73	87.98
	其中:股票	652,422,359.73	87.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	358,400.00	0.05
	其中:债券	358,400.00	0.05
	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	86,693,516.83	11.69
8	其他各项资产	2,054,599.01	0.28
9	合计	741,528,875.57	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	9,955,965.00	1.42

B	采矿业	20,620,825.67	2.94
C	制造业	440,434,650.72	62.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,267,698.00	2.61
E	建筑业	17,631,373.99	2.52
F	批发和零售业	15,780,803.39	2.25
G	交通运输、仓储和邮政业	13,182,752.00	1.88
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	61,394,731.36	8.76
J	金融业	14,194,783.00	2.03
K	房地产业	11,878,200.00	1.70
L	租赁和商务服务业	9,116,316.00	1.30
M	科学研究和技术服务业	1,954,138.40	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	6,560,120.11	0.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,786,181.78	0.83
R	文化、体育和娱乐业	5,659,212.31	0.81
S	综合	-	-
	合计	652,422,359.73	93.14

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	002449	国星光电	1,202,699	12,965,095.22	1.85
2	002254	泰和新材	541,800	10,624,698.00	1.52
3	600116	三峡水利	903,600	10,535,976.00	1.50
4	603599	广信股份	266,000	10,374,000.00	1.48
5	688122	西部超导	105,837	10,259,838.78	1.46
6	002436	兴森科技	730,000	10,220,000.00	1.46
7	688030	山石网科	340,210	10,090,628.60	1.44
8	600502	安徽建工	2,363,000	9,806,450.00	1.40
9	601375	中原证券	1,906,100	9,358,951.00	1.34
10	002850	科达利	56,700	9,091,278.00	1.30
11	300723	一品红	252,200	9,053,980.00	1.29
12	600057	厦门象屿	1,026,000	8,710,740.00	1.24
13	300379	东方通	294,428	8,694,458.84	1.24

14	600108	亚盛集团	2,445,500	8,632,615.00	1.23
15	600285	羚锐制药	543,914	8,593,841.20	1.23
16	300327	中颖电子	126,450	8,585,955.00	1.23
17	300775	三角防务	174,300	8,521,527.00	1.22
18	600360	华微电子	938,000	8,517,040.00	1.22
19	688200	华峰测控	15,859	8,118,222.10	1.16
20	603610	麒盛科技	290,935	7,523,579.10	1.07
21	603383	顶点软件	201,900	7,248,210.00	1.03
22	603236	移远通信	35,500	7,238,450.00	1.03
23	603612	索通发展	346,600	7,112,232.00	1.02
24	300390	天华超净	85,300	6,909,300.00	0.99
25	600710	苏美达	1,049,800	6,865,692.00	0.98
26	300395	菲利华	103,800	6,823,812.00	0.97
27	601666	平煤股份	803,600	6,726,132.00	0.96
28	603678	火炬电子	88,100	6,664,765.00	0.95
29	002407	多氟多	148,100	6,663,019.00	0.95
30	300294	博雅生物	165,700	6,354,595.00	0.91
31	600662	外服控股	882,900	6,321,564.00	0.90
32	002649	博彦科技	540,200	6,309,536.00	0.90
33	002043	兔宝宝	509,900	6,159,592.00	0.88
34	688066	航天宏图	84,393	6,135,371.10	0.88
35	000652	泰达股份	1,411,500	6,083,565.00	0.87
36	600882	妙可蓝多	107,700	6,031,200.00	0.86
37	603666	亿嘉和	80,120	6,018,614.40	0.86
38	300143	盈康生命	408,500	5,768,020.00	0.82
39	000667	美好置业	3,307,100	5,754,354.00	0.82
40	300573	兴齐眼药	41,700	5,704,560.00	0.81
41	000793	华闻集团	1,912,000	5,621,280.00	0.80
42	002597	金禾实业	107,100	5,499,585.00	0.79
43	002042	华孚时尚	1,200,700	5,487,199.00	0.78
44	688388	嘉元科技	43,611	5,475,361.05	0.78
45	688399	硕世生物	39,577	5,441,837.50	0.78
46	603606	东方电缆	105,400	5,392,264.00	0.77
47	002158	汉钟精机	197,300	5,254,099.00	0.75
48	688016	心脉医疗	20,948	5,210,605.52	0.74
49	688598	金博股份	14,576	5,175,063.04	0.74
50	300768	迪普科技	124,900	5,152,125.00	0.74
51	603588	高能环境	289,160	5,080,541.20	0.73
52	000823	超声电子	370,700	5,048,934.00	0.72
53	002738	中矿资源	70,000	4,925,200.00	0.70
54	300740	水羊股份	302,580	4,807,996.20	0.69
55	300770	新媒股份	79,900	4,794,000.00	0.68

56	002839	张家港行	822,200	4,735,872.00	0.68
57	300073	当升科技	54,400	4,725,728.00	0.67
58	688508	芯朋微	40,650	4,709,709.00	0.67
59	603283	赛腾股份	159,100	4,677,540.00	0.67
60	600110	诺德股份	286,402	4,568,111.90	0.65
61	600389	江山股份	110,300	4,535,536.00	0.65
62	600581	八一钢铁	722,235	4,485,079.35	0.64
63	300457	赢合科技	145,800	4,478,976.00	0.64
64	601619	嘉泽新能	861,800	4,446,888.00	0.63
65	300709	精研科技	73,800	4,424,310.00	0.63
66	002126	银轮股份	349,400	4,388,464.00	0.63
67	000498	山东路桥	707,900	4,374,822.00	0.62
68	002859	洁美科技	117,100	4,356,120.00	0.62
69	600123	兰花科创	463,000	4,338,310.00	0.62
70	603008	喜临门	108,900	4,250,367.00	0.61
71	300696	爱乐达	81,085	4,211,554.90	0.60
72	000933	神火股份	462,300	4,202,307.00	0.60
73	600971	恒源煤电	626,500	4,047,190.00	0.58
74	688116	天奈科技	27,088	4,043,967.52	0.58
75	600456	宝钛股份	55,700	3,998,146.00	0.57
76	603279	景津装备	83,500	3,872,730.00	0.55
77	002706	良信股份	211,480	3,768,573.60	0.54
78	000913	钱江摩托	257,500	3,653,925.00	0.52
79	300292	吴通控股	908,700	3,625,713.00	0.52
80	002611	东方精工	645,100	3,599,658.00	0.51
81	300171	东富龙	70,900	3,583,286.00	0.51
82	600206	有研新材	216,387	3,544,419.06	0.51
83	603027	千禾味业	144,867	3,488,397.36	0.50
84	002326	永太科技	67,703	3,467,070.63	0.49
85	600711	盛屯矿业	322,100	3,456,133.00	0.49
86	300055	万邦达	264,100	3,438,582.00	0.49
87	603713	密尔克卫	25,000	3,369,500.00	0.48
88	688050	爱博医疗	15,989	3,361,367.47	0.48
89	603520	司太立	51,200	3,328,000.00	0.48
90	688298	东方生物	14,421	3,324,040.50	0.47
91	600452	涪陵电力	163,100	3,284,834.00	0.47
92	300639	凯普生物	109,856	3,241,850.56	0.46
93	603043	广州酒家	130,119	3,130,663.14	0.45
94	600273	嘉化能源	259,700	3,004,729.00	0.43
95	002906	华阳集团	54,500	2,995,320.00	0.43
96	601588	北辰实业	1,204,700	2,987,656.00	0.43
97	300596	利安隆	65,014	2,910,026.64	0.42

98	600428	中远海特	575,900	2,902,536.00	0.41
99	002636	金安国纪	190,808	2,871,660.40	0.41
100	600185	格力地产	413,900	2,860,049.00	0.41
101	688019	安集科技	10,299	2,813,686.80	0.40
102	600596	新安股份	111,600	2,788,884.00	0.40
103	000917	电广传媒	402,100	2,718,196.00	0.39
104	688085	三友医疗	87,524	2,701,865.88	0.39
105	603688	石英股份	41,700	2,631,687.00	0.38
106	688033	天宜上佳	76,189	2,518,046.45	0.36
107	603305	旭升股份	49,900	2,489,012.00	0.36
108	688408	中信博	13,650	2,409,361.50	0.34
109	002643	万润股份	100,100	2,366,364.00	0.34
110	300208	青岛中程	210,800	2,285,072.00	0.33
111	601677	明泰铝业	50,500	2,226,545.00	0.32
112	300035	中科电气	73,400	2,220,350.00	0.32
113	688516	奥特维	8,707	2,139,484.04	0.31
114	300653	正海生物	30,600	2,043,162.00	0.29
115	002274	华昌化工	153,200	1,941,044.00	0.28
116	002977	天箭科技	22,500	1,801,350.00	0.26
117	600810	神马股份	137,700	1,714,365.00	0.24
118	688037	芯源微	9,747	1,645,293.60	0.23
119	300184	力源信息	227,700	1,580,238.00	0.23
120	300850	新强联	8,700	1,553,037.00	0.22
121	300748	金力永磁	34,200	1,535,238.00	0.22
122	600330	天通股份	92,500	1,501,275.00	0.21
123	002539	云图控股	111,000	1,472,970.00	0.21
124	000423	东阿阿胶	29,500	1,438,125.00	0.21
125	300355	蒙草生态	264,700	1,429,380.00	0.20
126	600096	云天化	71,500	1,402,830.00	0.20
127	002833	弘亚数控	43,400	1,396,612.00	0.20
128	300761	立华股份	35,000	1,323,350.00	0.19
129	300769	德方纳米	2,500	1,227,900.00	0.18
130	688368	晶丰明源	3,803	1,217,340.30	0.17
131	600496	精工钢构	274,800	1,170,648.00	0.17
132	002727	一心堂	29,400	1,132,194.00	0.16
133	601001	晋控煤业	111,147	1,068,122.67	0.15
134	300012	华测检测	39,100	1,050,617.00	0.15
135	688106	金宏气体	36,057	1,002,745.17	0.14
136	000848	承德露露	90,800	985,180.00	0.14
137	002332	仙琚制药	72,400	955,680.00	0.14
138	300470	中密控股	21,100	942,537.00	0.13
139	300118	东方日升	28,000	909,160.00	0.13

140	603026	石大胜华	4,516	894,122.84	0.13
141	002237	恒邦股份	75,000	876,750.00	0.13
142	688586	江航装备	25,479	863,738.10	0.12
143	000761	本钢板材	203,500	854,700.00	0.12
144	601965	中国汽研	44,896	835,514.56	0.12
145	300083	创世纪	47,400	676,872.00	0.10
146	300900	广联航空	19,700	676,695.00	0.10
147	603979	金诚信	30,100	646,548.00	0.09
148	605111	新洁能	3,600	641,160.00	0.09
149	688139	海尔生物	7,038	639,191.16	0.09
150	002135	东南网架	54,900	634,644.00	0.09
151	300252	金信诺	71,100	634,212.00	0.09
152	300232	洲明科技	70,200	627,588.00	0.09
153	603728	鸣志电器	25,600	606,976.00	0.09
154	000507	珠海港	91,200	589,152.00	0.08
155	300432	富临精工	18,200	535,080.00	0.08
156	002960	青鸟消防	8,500	412,675.00	0.06
157	605168	三人行	2,400	405,576.00	0.06
158	002192	融捷股份	2,600	338,390.00	0.05
159	002276	万马股份	36,700	330,667.00	0.05
160	002130	沃尔核材	40,000	330,000.00	0.05
161	603105	芯能科技	18,400	305,808.00	0.04
162	688017	绿的谐波	1,700	296,752.00	0.04
163	300409	道氏技术	12,200	295,850.00	0.04
164	300476	胜宏科技	9,600	290,400.00	0.04
165	300451	创业慧康	25,843	288,924.74	0.04
166	600641	万业企业	8,300	276,141.00	0.04
167	688390	固德威	600	275,748.00	0.04
168	688800	瑞可达	1,967	262,653.51	0.04
169	300672	国科微	1,400	259,700.00	0.04
170	688262	国芯科技	5,968	250,536.64	0.04
171	688788	科思科技	1,600	218,720.00	0.03
172	600295	鄂尔多斯	7,900	186,361.00	0.03
173	002239	奥特佳	50,900	185,785.00	0.03
174	600559	老白干酒	4,800	134,112.00	0.02
175	688296	和达科技	2,173	107,932.91	0.02
176	000567	海德股份	5,600	99,960.00	0.01
177	002585	双星新材	2,200	59,576.00	0.01
178	002635	安洁科技	3,400	57,902.00	0.01
179	600552	凯盛科技	4,700	55,084.00	0.01
180	301155	海力风电	457	44,214.75	0.01
181	301029	怡合达	455	40,890.85	0.01

182	301177	迪阿股份	350	40,628.00	0.01
183	688501	青达环保	1,759	37,132.49	0.01
184	603429	集友股份	1,400	36,540.00	0.01
185	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
186	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
187	301087	可孚医疗	385	29,005.90	0.00
188	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
189	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
190	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
191	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
192	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
193	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
194	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
195	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
196	301093	华兰股份	401	19,989.85	0.00
197	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
198	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
199	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
200	301096	百诚医药	234	18,376.02	0.00
201	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
202	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
203	301088	戎美股份	681	16,800.27	0.00
204	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
205	600063	皖维高新	2,600	15,938.00	0.00
206	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
207	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
208	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
209	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
210	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
211	301035	润丰股份	249	14,013.72	0.00
212	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
213	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
214	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
215	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
216	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
217	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
218	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
219	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
220	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
221	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
222	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
223	301039	中集车辆	754	9,432.54	0.00

224	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
225	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
226	300821	东岳硅材	500	9,140.00	0.00
227	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
228	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
229	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
230	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
231	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
232	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
233	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
234	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
235	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
236	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
237	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
238	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
239	300101	振芯科技	300	6,654.00	0.00
240	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
241	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
242	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
243	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
244	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
245	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
246	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
247	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
248	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
249	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
250	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
251	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
252	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
253	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
254	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
255	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	002254	泰和新材	29,245,595.00	20.99
2	300395	菲利华	22,913,969.32	16.44
3	603599	广信股份	22,557,469.14	16.19
4	002643	万润股份	20,989,163.00	15.06
5	600285	羚锐制药	20,690,794.02	14.85

6	600057	厦门象屿	20,473,702.10	14.69
7	300327	中颖电子	19,982,763.94	14.34
8	603612	索通发展	19,786,316.00	14.20
9	002777	久远银海	18,432,932.00	13.23
10	600502	安徽建工	17,835,327.00	12.80
11	002043	兔宝宝	17,721,975.00	12.72
12	000498	山东路桥	17,553,951.87	12.60
13	002649	博彦科技	17,527,200.00	12.58
14	600108	亚盛集团	17,312,740.00	12.42
15	600323	瀚蓝环境	17,197,612.04	12.34
16	603456	九洲药业	17,167,243.98	12.32
17	002850	科达利	16,871,682.00	12.11
18	300379	东方通	16,825,452.51	12.07
19	688066	航天宏图	16,677,276.29	11.97
20	300496	中科创达	16,140,928.30	11.58
21	300373	扬杰科技	15,928,831.66	11.43
22	002402	和而泰	15,909,741.92	11.42
23	002436	兴森科技	15,904,603.00	11.41
24	300639	凯普生物	15,864,881.03	11.38
25	603588	高能环境	15,411,959.20	11.06
26	603279	景津装备	14,950,425.00	10.73
27	000917	电广传媒	14,890,491.00	10.69
28	002449	国星光电	14,863,666.49	10.67
29	603108	润达医疗	14,219,688.20	10.20
30	600389	江山股份	14,194,309.00	10.19
31	002158	汉钟精机	13,712,511.16	9.84
32	601515	东风股份	13,484,342.20	9.68
33	688122	西部超导	13,454,152.17	9.65
34	002308	威创股份	13,319,738.00	9.56
35	300775	三角防务	13,311,319.11	9.55
36	603323	苏农银行	13,177,793.50	9.46
37	300110	华仁药业	13,142,752.00	9.43
38	603678	火炬电子	13,078,037.00	9.38
39	300299	富春股份	12,939,325.00	9.29
40	300012	华测检测	12,909,502.00	9.26
41	603337	杰克股份	12,879,739.20	9.24
42	603383	顶点软件	12,808,741.00	9.19
43	601677	明泰铝业	12,762,078.69	9.16
44	300390	天华超净	12,728,594.80	9.13
45	601375	中原证券	12,582,133.00	9.03
46	600123	兰花科创	12,522,721.00	8.99
47	002042	华孚时尚	12,443,271.00	8.93

48	603728	鸣志电器	12,418,092.54	8.91
49	002258	利尔化学	12,390,703.00	8.89
50	600116	三峡水利	12,380,207.00	8.88
51	002407	多氟多	12,325,436.00	8.84
52	600710	苏美达	12,323,238.00	8.84
53	600206	有研新材	12,120,538.35	8.70
54	688200	华峰测控	11,896,598.44	8.54
55	688016	心脉医疗	11,796,588.26	8.47
56	000733	振华科技	11,749,562.59	8.43
57	600596	新安股份	11,723,627.08	8.41
58	688005	容百科技	11,677,299.41	8.38
59	603026	石大胜华	11,597,402.64	8.32
60	600114	东睦股份	11,527,747.50	8.27
61	300224	正海磁材	11,493,779.54	8.25
62	000933	神火股份	11,479,764.00	8.24
63	600110	诺德股份	11,454,774.70	8.22
64	300696	爱乐达	11,431,223.25	8.20
65	300740	水羊股份	11,396,091.90	8.18
66	300406	九强生物	11,382,324.28	8.17
67	000915	华特达因	11,381,940.90	8.17
68	600360	华微电子	11,377,708.00	8.16
69	002636	金安国纪	11,343,491.28	8.14
70	002833	弘亚数控	11,273,920.60	8.09
71	000923	河钢资源	11,075,812.00	7.95
72	603005	晶方科技	11,025,296.23	7.91
73	688388	嘉元科技	10,979,813.70	7.88
74	603606	东方电缆	10,967,160.57	7.87
75	002859	洁美科技	10,856,295.00	7.79
76	600169	太原重工	10,824,747.00	7.77
77	002332	仙琚制药	10,781,157.00	7.74
78	300748	金力永磁	10,762,826.00	7.72
79	688030	山石网科	10,760,014.10	7.72
80	600581	八一钢铁	10,692,768.31	7.67
81	300101	振芯科技	10,589,747.90	7.60
82	601678	滨化股份	10,517,146.10	7.55
83	603613	国联股份	10,469,306.90	7.51
84	601001	晋控煤业	10,409,689.96	7.47
85	300055	万邦达	10,345,313.00	7.42
86	002313	日海智能	10,306,819.48	7.40
87	300294	博雅生物	10,172,870.00	7.30
88	000818	航锦科技	10,142,363.00	7.28
89	600966	博汇纸业	10,133,604.00	7.27

90	300073	当升科技	10,116,722.51	7.26
91	000652	泰达股份	10,019,252.00	7.19
92	002906	华阳集团	9,903,756.80	7.11
93	300755	华致酒行	9,859,009.20	7.07
94	002918	蒙娜丽莎	9,736,132.00	6.99
95	603566	普莱柯	9,697,973.00	6.96
96	600273	嘉化能源	9,622,905.00	6.91
97	603043	广州酒家	9,603,411.23	6.89
98	300171	东富龙	9,585,875.82	6.88
99	002611	东方精工	9,578,249.00	6.87
100	002929	润建股份	9,577,334.63	6.87
101	603305	旭升股份	9,540,788.00	6.85
102	300457	赢合科技	9,534,047.00	6.84
103	601666	平煤股份	9,504,320.00	6.82
104	300662	科锐国际	9,296,230.00	6.67
105	300723	一品红	9,255,219.92	6.64
106	600711	盛屯矿业	9,210,657.00	6.61
107	603283	赛腾股份	9,083,697.00	6.52
108	603666	亿嘉和	9,002,144.92	6.46
109	300659	中孚信息	8,990,794.00	6.45
110	600810	神马股份	8,862,616.00	6.36
111	688298	东方生物	8,856,412.27	6.36
112	000973	佛塑科技	8,711,088.00	6.25
113	600096	云天化	8,674,801.75	6.22
114	603610	麒盛科技	8,672,640.94	6.22
115	603579	荣泰健康	8,320,623.00	5.97
116	002733	雄韬股份	8,300,400.00	5.96
117	600366	宁波韵升	8,285,387.00	5.95
118	300783	三只松鼠	8,280,909.00	5.94
119	002126	银轮股份	8,276,988.00	5.94
120	002274	华昌化工	8,251,552.00	5.92
121	002568	百润股份	8,198,545.00	5.88
122	300378	鼎捷软件	8,138,988.50	5.84
123	603688	石英股份	8,093,114.00	5.81
124	601918	新集能源	8,025,175.20	5.76
125	300369	绿盟科技	8,016,989.00	5.75
126	603186	华正新材	7,925,388.12	5.69
127	300458	全志科技	7,889,959.00	5.66
128	600129	太极集团	7,889,436.77	5.66
129	688033	天宜上佳	7,885,059.80	5.66
130	600971	恒源煤电	7,871,936.00	5.65
131	000666	经纬纺机	7,757,301.00	5.57

132	600183	生益科技	7,599,090.26	5.45
133	002537	海联金汇	7,585,088.12	5.44
134	000875	吉电股份	7,574,803.00	5.44
135	002531	天顺风能	7,534,724.40	5.41
136	603012	创力集团	7,489,080.00	5.37
137	601369	陕鼓动力	7,460,923.00	5.35
138	603267	鸿远电子	7,364,373.72	5.28
139	600864	哈投股份	7,343,354.00	5.27
140	603236	移远通信	7,341,776.00	5.27
141	300143	盈康生命	7,259,710.00	5.21
142	300573	兴齐眼药	7,223,758.00	5.18
143	000851	高鸿股份	7,218,741.41	5.18
144	300398	飞凯材料	7,208,568.24	5.17
145	600483	福能股份	7,202,798.58	5.17
146	600531	豫光金铅	7,195,749.00	5.16
147	002539	云图控股	7,110,545.00	5.10
148	600063	皖维高新	7,050,987.90	5.06
149	600223	鲁商发展	7,033,972.00	5.05
150	603882	金域医学	7,026,066.00	5.04
151	688116	天奈科技	7,012,467.48	5.03
152	002556	辉隆股份	6,982,672.50	5.01
153	603508	思维列控	6,959,236.20	4.99
154	300768	迪普科技	6,925,564.00	4.97
155	600510	黑牡丹	6,853,103.47	4.92
156	300319	麦捷科技	6,808,119.00	4.89
157	000683	远兴能源	6,753,425.00	4.85
158	300363	博腾股份	6,616,477.00	4.75
159	600008	首创环保	6,613,906.00	4.75
160	002706	良信股份	6,613,723.40	4.75
161	688399	硕世生物	6,603,525.92	4.74
162	600452	涪陵电力	6,590,238.36	4.73
163	000725	京东方 A	6,588,583.00	4.73
164	000667	美好置业	6,548,027.00	4.70
165	002326	永太科技	6,545,467.76	4.70
166	300118	东方日升	6,488,545.00	4.66
167	601929	吉视传媒	6,481,027.00	4.65
168	000657	中钨高新	6,470,554.00	4.64
169	600662	外服控股	6,469,012.00	4.64
170	300725	药石科技	6,467,046.48	4.64
171	603345	安井食品	6,316,102.68	4.53
172	603803	瑞斯康达	6,224,443.00	4.47
173	300470	中密控股	6,220,493.00	4.46

174	000793	华闻集团	6,191,997.00	4.44
175	603520	司太立	6,151,094.08	4.41
176	300747	锐科激光	6,149,503.69	4.41
177	600456	宝钛股份	6,136,880.00	4.40
178	600552	凯盛科技	6,127,682.00	4.40
179	600882	妙可蓝多	6,124,114.00	4.39
180	000848	承德露露	6,077,276.11	4.36
181	002645	华宏科技	6,062,371.32	4.35
182	000011	深物业 A	5,958,152.00	4.28
183	000810	创维数字	5,952,517.00	4.27
184	603027	千禾味业	5,932,966.32	4.26
185	600105	永鼎股份	5,920,277.00	4.25
186	603718	海利生物	5,903,334.00	4.24
187	300451	创业慧康	5,879,989.51	4.22
188	300465	高伟达	5,862,109.50	4.21
189	688598	金博股份	5,846,061.51	4.20
190	688508	芯朋微	5,722,632.45	4.11
191	300208	青岛中程	5,683,816.00	4.08
192	002035	华帝股份	5,675,879.00	4.07
193	300672	国科微	5,666,652.00	4.07
194	600496	精工钢构	5,589,004.00	4.01
195	600072	中船科技	5,573,523.00	4.00
196	002597	金禾实业	5,559,303.00	3.99
197	600587	新华医疗	5,528,565.63	3.97
198	000555	神州信息	5,482,180.08	3.93
199	002839	张家港行	5,472,466.00	3.93
200	300502	新易盛	5,462,022.63	3.92
201	000913	钱江摩托	5,423,707.00	3.89
202	300633	开立医疗	5,401,477.00	3.88
203	300114	中航电测	5,393,772.00	3.87
204	688368	晶丰明源	5,365,303.58	3.85
205	300613	富瀚微	5,363,670.00	3.85
206	603010	万盛股份	5,353,756.40	3.84
207	688018	乐鑫科技	5,347,676.85	3.84
208	300724	捷佳伟创	5,301,674.00	3.80
209	600986	浙文互联	5,240,751.00	3.76
210	000823	超声电子	5,221,074.00	3.75
211	002314	南山控股	5,198,830.00	3.73
212	603103	横店影视	5,149,198.17	3.69
213	603869	新智认知	5,082,411.20	3.65
214	300624	万兴科技	4,970,926.60	3.57
215	600729	重庆百货	4,923,014.00	3.53

216	603596	伯特利	4,883,719.58	3.50
217	300034	钢研高纳	4,879,965.23	3.50
218	601339	百隆东方	4,841,837.00	3.47
219	600337	美克家居	4,824,845.00	3.46
220	300590	移为通信	4,819,797.00	3.46
221	600550	保变电气	4,804,701.00	3.45
222	000550	江铃汽车	4,783,211.05	3.43
223	300761	立华股份	4,710,216.00	3.38
224	002738	中矿资源	4,705,465.00	3.38
225	600185	格力地产	4,673,964.00	3.35
226	603169	兰石重装	4,622,058.00	3.32
227	300666	江丰电子	4,604,099.79	3.30
228	300081	恒信东方	4,599,372.00	3.30
229	300751	迈为股份	4,566,797.00	3.28
230	688085	三友医疗	4,545,934.05	3.26
231	300266	兴源环境	4,538,062.00	3.26
232	300770	新媒股份	4,519,781.00	3.24
233	601619	嘉泽新能	4,490,698.00	3.22
234	603128	华贸物流	4,473,039.50	3.21
235	000811	冰轮环境	4,469,735.00	3.21
236	002106	莱宝高科	4,455,897.99	3.20
237	002697	红旗连锁	4,432,053.00	3.18
238	002840	华统股份	4,382,714.60	3.14
239	300596	利安隆	4,374,100.00	3.14
240	300769	德方纳米	4,369,176.00	3.14
241	000507	珠海港	4,366,411.00	3.13
242	603639	海利尔	4,332,747.75	3.11
243	300353	东土科技	4,328,692.00	3.11
244	300709	精研科技	4,326,261.00	3.10
245	601928	凤凰传媒	4,293,909.00	3.08
246	603180	金牌厨柜	4,265,050.88	3.06
247	000926	福星股份	4,258,984.00	3.06
248	600295	鄂尔多斯	4,232,754.00	3.04
249	300119	瑞普生物	4,232,713.00	3.04
250	688037	芯源微	4,200,457.14	3.01
251	603444	吉比特	4,187,866.99	3.01
252	300355	蒙草生态	4,165,297.00	2.99
253	002479	富春环保	4,158,934.00	2.98
254	603727	博迈科	4,098,169.54	2.94
255	300571	平治信息	4,089,296.00	2.93
256	603466	风语筑	4,045,210.93	2.90
257	002726	龙大美食	4,021,807.80	2.89

258	002048	宁波华翔	3,993,500.00	2.87
259	002161	远望谷	3,993,387.00	2.87
260	600426	华鲁恒升	3,959,686.00	2.84
261	002637	赞宇科技	3,945,271.00	2.83
262	300307	慈星股份	3,944,968.00	2.83
263	603008	喜临门	3,918,228.00	2.81
264	601965	中国汽研	3,904,516.52	2.80
265	000921	海信家电	3,897,672.18	2.80
266	600480	凌云股份	3,875,451.00	2.78
267	601636	旗滨集团	3,871,210.00	2.78
268	300785	值得买	3,856,101.86	2.77
269	600740	山西焦化	3,817,776.00	2.74
270	002920	德赛西威	3,787,001.00	2.72
271	000403	派林生物	3,772,830.20	2.71
272	600248	陕西建工	3,772,810.00	2.71
273	300007	汉威科技	3,768,196.00	2.70
274	002206	海利得	3,765,339.00	2.70
275	688050	爱博医疗	3,760,145.48	2.70
276	000026	飞亚达	3,750,347.00	2.69
277	002382	蓝帆医疗	3,729,798.00	2.68
278	002662	京威股份	3,724,145.00	2.67
279	300409	道氏技术	3,723,562.00	2.67
280	002262	恩华药业	3,684,319.00	2.64
281	600782	新钢股份	3,668,556.00	2.63
282	300158	振东制药	3,618,760.00	2.60
283	300292	吴通控股	3,617,105.00	2.60
284	002409	雅克科技	3,604,942.00	2.59
285	300653	正海生物	3,604,554.50	2.59
286	300476	胜宏科技	3,543,810.00	2.54
287	603416	信捷电气	3,529,265.90	2.53
288	002413	雷科防务	3,515,546.00	2.52
289	300567	精测电子	3,509,406.20	2.52
290	000887	中鼎股份	3,480,925.00	2.50
291	603979	金诚信	3,453,930.00	2.48
292	300705	九典制药	3,434,080.00	2.46
293	601588	北辰实业	3,424,878.00	2.46
294	600742	一汽富维	3,392,950.00	2.43
295	688019	安集科技	3,387,296.74	2.43
296	300036	超图软件	3,377,125.00	2.42
297	300477	合纵科技	3,325,921.00	2.39
298	603690	至纯科技	3,294,237.55	2.36
299	605168	三人行	3,293,444.00	2.36

300	002603	以岭药业	3,266,362.00	2.34
301	300593	新雷能	3,259,441.00	2.34
302	002498	汉缆股份	3,227,425.00	2.32
303	600132	重庆啤酒	3,223,103.00	2.31
304	002097	山河智能	3,221,093.00	2.31
305	603185	上机数控	3,208,154.00	2.30
306	600246	万通发展	3,176,497.00	2.28
307	600668	尖峰集团	3,167,842.00	2.27
308	603429	集友股份	3,167,379.00	2.27
309	688268	华特气体	3,166,136.96	2.27
310	603985	恒润股份	3,161,108.33	2.27
311	300102	乾照光电	3,150,344.00	2.26
312	603393	新天然气	3,107,575.80	2.23
313	688139	海尔生物	3,092,351.49	2.22
314	601567	三星医疗	3,076,648.00	2.21
315	603713	密尔克卫	3,075,670.00	2.21
316	002056	横店东磁	3,071,305.66	2.20
317	002034	旺能环境	3,068,921.00	2.20
318	000797	中国武夷	3,067,878.00	2.20
319	300763	锦浪科技	3,065,011.00	2.20
320	300452	山河药辅	3,036,299.52	2.18
321	603626	科森科技	3,005,392.94	2.16
322	601882	海天精工	3,005,343.00	2.16
323	002204	大连重工	3,003,255.00	2.16
324	000560	我爱我家	2,995,486.00	2.15
325	002025	航天电器	2,989,717.00	2.15
326	600211	西藏药业	2,969,471.00	2.13
327	002483	润邦股份	2,958,858.00	2.12
328	688006	杭可科技	2,954,882.67	2.12
329	002139	拓邦股份	2,943,608.00	2.11
330	600428	中远海特	2,889,230.00	2.07
331	002020	京新药业	2,853,851.00	2.05
332	600746	江苏索普	2,836,686.00	2.04
333	600348	华阳股份	2,830,344.00	2.03
334	601212	白银有色	2,819,635.00	2.02
335	300229	拓尔思	2,807,926.00	2.01
336	688408	中信博	2,798,918.38	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	002643	万润股份	20,249,090.00	14.53
2	603456	九洲药业	19,678,243.03	14.12
3	300395	菲利华	19,265,097.98	13.82
4	300373	扬杰科技	18,912,779.00	13.57
5	002254	泰和新材	18,566,157.96	13.32
6	300496	中科创达	18,301,203.95	13.13
7	002777	久远银海	17,919,255.91	12.86
8	002402	和而泰	16,931,758.38	12.15
9	600323	瀚蓝环境	16,462,694.33	11.81
10	603612	索通发展	16,346,689.00	11.73
11	600285	羚锐制药	14,701,141.00	10.55
12	002308	威创股份	14,680,904.60	10.53
13	300299	富春股份	14,404,783.70	10.34
14	603323	苏农银行	13,937,777.33	10.00
15	300639	凯普生物	13,850,401.79	9.94
16	603108	润达医疗	13,777,278.00	9.89
17	603599	广信股份	13,768,237.00	9.88
18	300110	华仁药业	13,606,158.40	9.76
19	300101	振芯科技	13,095,567.80	9.40
20	300327	中颖电子	13,094,033.45	9.40
21	603728	鸣志电器	13,052,828.00	9.37
22	002043	兔宝宝	12,619,341.80	9.06
23	000733	振华科技	12,588,770.00	9.03
24	000498	山东路桥	12,565,409.69	9.02
25	600114	东睦股份	12,490,665.00	8.96
26	002649	博彦科技	12,353,474.00	8.86
27	688005	容百科技	12,350,533.32	8.86
28	601678	滨化股份	12,280,333.38	8.81
29	603005	晶方科技	12,174,369.19	8.74
30	600057	厦门象屿	12,142,488.98	8.71
31	300012	华测检测	12,036,599.00	8.64
32	300748	金力永磁	11,807,106.29	8.47
33	000915	华特达因	11,804,269.90	8.47
34	603337	杰克股份	11,609,808.48	8.33
35	601515	东风股份	11,418,970.40	8.19
36	300224	正海磁材	11,284,438.00	8.10
37	000917	电广传媒	11,267,600.00	8.09
38	603279	景津装备	11,210,621.00	8.04
39	603026	石大胜华	11,185,282.00	8.03
40	600966	博汇纸业	11,070,405.96	7.94
41	600169	太原重工	11,057,017.00	7.93
42	603613	国联股份	10,989,090.00	7.89

43	002258	利尔化学	10,841,008.00	7.78
44	002313	日海智能	10,733,973.67	7.70
45	000818	航锦科技	10,536,124.00	7.56
46	603588	高能环境	10,530,155.00	7.56
47	603566	普莱柯	10,458,565.35	7.50
48	688066	航天宏图	10,379,757.38	7.45
49	601677	明泰铝业	10,374,005.90	7.44
50	002929	润建股份	10,343,551.00	7.42
51	000923	河钢资源	10,097,113.00	7.25
52	300406	九强生物	10,072,414.00	7.23
53	601001	晋控煤业	10,065,777.00	7.22
54	002332	仙琚制药	9,940,752.00	7.13
55	600389	江山股份	9,828,915.00	7.05
56	300755	华致酒行	9,820,120.00	7.05
57	300662	科锐国际	9,748,897.00	7.00
58	600096	云天化	9,572,803.00	6.87
59	600366	宁波韵升	9,521,144.00	6.83
60	600711	盛屯矿业	9,399,265.71	6.74
61	002531	天顺风能	9,323,996.00	6.69
62	600206	有研新材	9,202,306.00	6.60
63	300378	鼎捷软件	9,086,151.90	6.52
64	300458	全志科技	9,067,663.00	6.51
65	601918	新集能源	9,056,797.50	6.50
66	002833	弘亚数控	8,933,934.16	6.41
67	300696	爱乐达	8,899,279.60	6.39
68	603882	金域医学	8,890,843.71	6.38
69	000973	佛塑科技	8,704,173.00	6.25
70	600223	鲁商发展	8,645,260.59	6.20
71	600502	安徽建工	8,552,337.00	6.14
72	600108	亚盛集团	8,509,039.00	6.11
73	300740	水羊股份	8,497,883.09	6.10
74	002158	汉钟精机	8,327,215.22	5.98
75	603267	鸿远电子	8,291,240.00	5.95
76	603305	旭升股份	8,276,649.00	5.94
77	002850	科达利	8,275,539.00	5.94
78	002539	云图控股	8,262,008.00	5.93
79	300398	飞凯材料	8,250,289.00	5.92
80	002636	金安国纪	8,236,327.00	5.91
81	300379	东方通	8,235,287.00	5.91
82	000875	吉电股份	8,206,649.50	5.89
83	603579	荣泰健康	8,151,285.00	5.85
84	300659	中孚信息	8,149,205.00	5.85

85	601369	陕鼓动力	8,141,617.43	5.84
86	002906	华阳集团	8,119,689.00	5.83
87	603186	华正新材	8,103,247.61	5.81
88	603606	东方电缆	8,042,845.40	5.77
89	000851	高鸿股份	8,001,259.10	5.74
90	300369	绿盟科技	7,979,442.00	5.73
91	002568	百润股份	7,936,928.80	5.70
92	600483	福能股份	7,903,410.13	5.67
93	002918	蒙娜丽莎	7,878,499.00	5.65
94	002733	雄韬股份	7,730,586.25	5.55
95	300783	三只松鼠	7,685,865.24	5.52
96	000666	经纬纺机	7,680,780.00	5.51
97	600129	太极集团	7,592,584.28	5.45
98	603012	创力集团	7,580,936.00	5.44
99	600123	兰花科创	7,575,977.00	5.44
100	300055	万邦达	7,514,284.72	5.39
101	000657	中钨高新	7,411,798.32	5.32
102	600008	首创环保	7,345,431.20	5.27
103	300363	博腾股份	7,323,549.30	5.26
104	002537	海联金汇	7,207,602.44	5.17
105	002042	华孚时尚	7,191,860.00	5.16
106	300724	捷佳伟创	7,183,082.00	5.15
107	603043	广州酒家	7,180,300.60	5.15
108	002645	华宏科技	7,173,762.77	5.15
109	600596	新安股份	7,092,304.00	5.09
110	002556	辉隆股份	7,090,324.00	5.09
111	300319	麦捷科技	7,062,596.00	5.07
112	600063	皖维高新	7,009,842.68	5.03
113	600183	生益科技	6,999,680.00	5.02
114	600273	嘉化能源	6,981,378.00	5.01
115	603345	安井食品	6,940,399.04	4.98
116	002274	华昌化工	6,933,408.00	4.98
117	600581	八一钢铁	6,928,929.52	4.97
118	300119	瑞普生物	6,855,543.00	4.92
119	601929	吉视传媒	6,815,566.00	4.89
120	603508	思维列控	6,812,613.20	4.89
121	603678	火炬电子	6,779,362.00	4.86
122	600864	哈投股份	6,729,322.00	4.83
123	300118	东方日升	6,640,433.00	4.77
124	600110	诺德股份	6,627,197.00	4.76
125	000933	神火股份	6,620,942.82	4.75
126	600531	豫光金铅	6,508,433.00	4.67

127	300451	创业慧康	6,450,925.18	4.63
128	603169	兰石重装	6,418,481.00	4.61
129	002859	洁美科技	6,390,329.80	4.59
130	002611	东方精工	6,358,910.00	4.56
131	600105	永鼎股份	6,340,223.00	4.55
132	002436	兴森科技	6,295,506.00	4.52
133	688016	心脉医疗	6,205,189.04	4.45
134	603803	瑞斯康达	6,189,330.82	4.44
135	600510	黑牡丹	6,185,356.44	4.44
136	600810	神马股份	6,160,325.00	4.42
137	000725	京东方 A	6,084,948.00	4.37
138	000683	远兴能源	6,046,659.00	4.34
139	300725	药石科技	6,011,308.50	4.31
140	688388	嘉元科技	5,996,624.95	4.30
141	002407	多氟多	5,987,793.00	4.30
142	603688	石英股份	5,951,531.00	4.27
143	000810	创维数字	5,944,804.00	4.27
144	603383	顶点软件	5,869,252.00	4.21
145	300747	锐科激光	5,863,013.78	4.21
146	300457	赢合科技	5,845,799.00	4.19
147	600552	凯盛科技	5,844,918.00	4.19
148	600710	苏美达	5,838,370.00	4.19
149	300672	国科微	5,832,317.00	4.19
150	600986	浙文互联	5,794,105.00	4.16
151	300171	东富龙	5,755,963.74	4.13
152	300666	江丰电子	5,745,658.46	4.12
153	300114	中航电测	5,738,910.00	4.12
154	300073	当升科技	5,718,233.03	4.10
155	600587	新华医疗	5,637,298.00	4.05
156	603718	海利生物	5,606,066.00	4.02
157	002139	拓邦股份	5,594,634.50	4.01
158	603010	万盛股份	5,575,171.80	4.00
159	002726	龙大美食	5,569,595.20	4.00
160	688033	天宜上佳	5,561,536.43	3.99
161	300465	高伟达	5,534,084.00	3.97
162	300633	开立医疗	5,484,869.00	3.94
163	000011	深物业 A	5,456,573.00	3.92
164	300624	万兴科技	5,423,572.72	3.89
165	688298	东方生物	5,411,122.41	3.88
166	000555	神州信息	5,410,022.47	3.88
167	603869	新智认知	5,400,150.87	3.88
168	603596	伯特利	5,390,158.34	3.87

169	600072	中船科技	5,295,208.80	3.80
170	000026	飞亚达	5,197,617.00	3.73
171	600742	一汽富维	5,164,071.80	3.71
172	300034	钢研高纳	5,155,780.21	3.70
173	601636	旗滨集团	5,153,610.00	3.70
174	002035	华帝股份	5,145,851.00	3.69
175	002056	横店东磁	5,051,818.60	3.63
176	601222	林洋能源	5,045,011.28	3.62
177	300502	新易盛	5,017,249.05	3.60
178	300613	富瀚微	5,008,096.00	3.59
179	600782	新钢股份	4,998,028.00	3.59
180	300590	移为通信	4,981,705.00	3.57
181	601339	百隆东方	4,930,598.55	3.54
182	300470	中密控股	4,923,079.00	3.53
183	600550	保变电气	4,882,424.40	3.50
184	002697	红旗连锁	4,871,161.94	3.50
185	600729	重庆百货	4,857,720.00	3.49
186	000811	冰轮环境	4,845,349.00	3.48
187	000921	海信家电	4,829,391.00	3.47
188	688018	乐鑫科技	4,823,463.06	3.46
189	000550	江铃汽车	4,794,399.45	3.44
190	300266	兴源环境	4,746,031.00	3.41
191	002314	南山控股	4,735,505.40	3.40
192	002382	蓝帆医疗	4,679,923.00	3.36
193	002920	德赛西威	4,658,027.00	3.34
194	000848	承德露露	4,653,736.11	3.34
195	002106	莱宝高科	4,629,582.00	3.32
196	300751	迈为股份	4,584,751.00	3.29
197	300390	天华超净	4,579,889.00	3.29
198	300571	平治信息	4,558,148.00	3.27
199	300353	东土科技	4,522,680.00	3.25
200	300081	恒信东方	4,505,970.00	3.23
201	002641	公元股份	4,447,870.00	3.19
202	603103	横店影视	4,442,268.25	3.19
203	603128	华贸物流	4,395,332.90	3.15
204	300775	三角防务	4,377,741.79	3.14
205	002048	宁波华翔	4,375,945.00	3.14
206	300593	新雷能	4,372,010.60	3.14
207	002206	海利得	4,351,726.38	3.12
208	600480	凌云股份	4,351,089.57	3.12
209	000926	福星股份	4,349,843.00	3.12
210	300007	汉威科技	4,300,374.00	3.09

211	603429	集友股份	4,259,657.00	3.06
212	600426	华鲁恒升	4,243,417.80	3.04
213	603639	海利尔	4,234,938.55	3.04
214	603727	博迈科	4,234,187.11	3.04
215	002161	远望谷	4,218,811.88	3.03
216	002479	富春环保	4,206,270.00	3.02
217	600295	鄂尔多斯	4,198,906.98	3.01
218	601928	凤凰传媒	4,190,590.00	3.01
219	002840	华统股份	4,185,156.21	3.00
220	603180	金牌厨柜	4,175,660.63	3.00
221	000652	泰达股份	4,174,176.00	3.00
222	688122	西部超导	4,162,173.94	2.99
223	603283	赛腾股份	4,118,725.00	2.96
224	603666	亿嘉和	4,109,114.41	2.95
225	603444	吉比特	4,102,609.00	2.94
226	000507	珠海港	4,053,943.00	2.91
227	600496	精工钢构	4,046,058.00	2.90
228	603520	司太立	4,019,819.46	2.88
229	600248	陕西建工	4,016,038.00	2.88
230	601882	海天精工	4,007,138.00	2.88
231	002614	奥佳华	3,984,033.46	2.86
232	601666	平煤股份	3,968,255.00	2.85
233	688368	晶丰明源	3,961,796.20	2.84
234	603686	福龙马	3,957,585.00	2.84
235	000600	建投能源	3,939,460.00	2.83
236	603466	风语筑	3,913,694.05	2.81
237	600337	美克家居	3,851,795.00	2.76
238	300409	道氏技术	3,843,721.00	2.76
239	300294	博雅生物	3,832,779.48	2.75
240	600971	恒源煤电	3,819,914.00	2.74
241	002637	赞宇科技	3,791,429.00	2.72
242	000403	派林生物	3,779,553.20	2.71
243	603626	科森科技	3,762,970.11	2.70
244	002662	京威股份	3,741,443.00	2.68
245	600461	洪城环境	3,727,157.00	2.67
246	002409	雅克科技	3,706,285.00	2.66
247	002126	银轮股份	3,693,283.50	2.65
248	000887	中鼎股份	3,688,902.00	2.65
249	603416	信捷电气	3,668,892.00	2.63
250	601375	中原证券	3,662,718.00	2.63
251	300785	值得买	3,661,912.20	2.63
252	300307	慈星股份	3,654,977.00	2.62

253	300476	胜宏科技	3,628,145.00	2.60
254	600132	重庆啤酒	3,592,968.00	2.58
255	300567	精测电子	3,577,730.75	2.57
256	603985	恒润股份	3,539,280.70	2.54
257	002262	恩华药业	3,489,843.00	2.50
258	601699	潞安环能	3,473,632.00	2.49
259	688116	天奈科技	3,462,359.49	2.48
260	002413	雷科防务	3,423,222.00	2.46
261	603393	新天然气	3,391,906.20	2.43
262	000951	中国重汽	3,379,400.00	2.42
263	002603	以岭药业	3,361,711.60	2.41
264	600740	山西焦化	3,361,204.00	2.41
265	600452	涪陵电力	3,359,544.00	2.41
266	300477	合纵科技	3,359,457.00	2.41
267	300036	超图软件	3,358,645.00	2.41
268	603886	元祖股份	3,323,670.00	2.39
269	603690	至纯科技	3,274,103.00	2.35
270	300394	天孚通信	3,243,362.20	2.33
271	600746	江苏索普	3,240,538.00	2.33
272	002498	汉缆股份	3,234,500.00	2.32
273	300705	九典制药	3,221,971.00	2.31
274	600459	贵研铂业	3,218,558.19	2.31
275	603901	永创智能	3,206,655.00	2.30
276	300355	蒙草生态	3,178,935.00	2.28
277	603979	金诚信	3,174,012.00	2.28
278	600246	万通发展	3,151,350.00	2.26
279	600668	尖峰集团	3,150,615.00	2.26
280	688006	杭可科技	3,132,851.35	2.25
281	605168	三人行	3,130,799.00	2.25
282	300208	青岛中程	3,125,555.00	2.24
283	601567	三星医疗	3,125,464.00	2.24
284	002204	大连重工	3,120,529.00	2.24
285	600116	三峡水利	3,118,935.00	2.24
286	600141	兴发集团	3,100,577.00	2.22
287	000012	南玻 A	3,096,785.10	2.22
288	002483	润邦股份	3,090,207.00	2.22
289	688200	华峰测控	3,088,275.76	2.22
290	002034	旺能环境	3,084,886.00	2.21
291	002129	中环股份	3,084,358.00	2.21
292	300158	振东制药	3,075,868.00	2.21
293	002020	京新药业	3,069,758.00	2.20
294	601965	中国汽研	3,054,311.00	2.19

295	000825	太钢不锈	3,030,815.00	2.17
296	002097	山河智能	3,030,235.00	2.17
297	603871	嘉友国际	3,003,498.72	2.16
298	600507	方大特钢	2,998,248.00	2.15
299	300763	锦浪科技	2,981,416.00	2.14
300	300761	立华股份	2,945,177.00	2.11
301	002425	凯撒文化	2,939,574.00	2.11
302	002201	正威新材	2,918,364.00	2.09
303	300039	上海凯宝	2,910,407.00	2.09
304	000560	我爱我家	2,892,638.00	2.08
305	600211	西藏药业	2,887,063.00	2.07
306	300102	乾照光电	2,885,102.00	2.07
307	000797	中国武夷	2,883,019.88	2.07
308	688037	芯源微	2,873,129.79	2.06
309	600562	国睿科技	2,847,193.98	2.04
310	603185	上机数控	2,837,765.00	2.04
311	300452	山河药辅	2,833,715.76	2.03
312	600348	华阳股份	2,831,615.00	2.03
313	603238	诺邦股份	2,829,152.72	2.03
314	600569	安阳钢铁	2,820,027.00	2.02

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	3,067,063,126.70
卖出股票收入（成交）总额	2,628,515,814.92

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）	358,400.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	358,400.00	0.05
----	----	------------	------

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	113635	升 21 转债	2,560	358,400.00	0.05

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

本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

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

本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	130,491.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,603.93
5	应收申购款	1,917,503.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,054,599.01

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 (%)
38,353	9,946.58	170,241,121.54	44.63	211,239,961.39	55.37

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	79,013.39	0.020712

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（2018年2月6日）基金份额总额	1,784,551,427.10
本报告期期初基金份额总额	100,162,131.71
本报告期基金总申购份额	493,938,059.34
减：本报告期基金总赎回份额	212,619,108.12
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	381,481,082.93

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

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已经连续 4 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 55,000.00 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	
中信建投证券股份有限公司	2	928,583,232.41	16.36%	864,797.89	16.36%	-
中泰证券股份有限公司	2	866,557,633.08	15.26%	807,034.98	15.26%	-
光大证券股份有限公司	2	825,692,541.49	14.54%	768,980.86	14.54%	-
广发证券股份有限公司	1	492,241,908.49	8.67%	458,426.78	8.67%	-
长江证券股份有限公司	1	432,914,772.54	7.63%	403,177.27	7.63%	-
西部证券股份有限公司	2	398,359,745.64	7.02%	370,993.72	7.02%	-
招商证券股份有限公司	1	335,029,242.04	5.90%	312,013.55	5.90%	-

中信证券股份有限公司	4	295,533,372.68	5.21%	275,232.22	5.21%	本期新增 1 个
国泰君安证券股份有限公司	1	252,950,805.74	4.46%	235,576.15	4.46%	-
华创证券有限责任公司	1	187,430,313.89	3.30%	174,559.04	3.30%	-
安信证券股份有限公司	1	162,348,543.64	2.86%	151,192.62	2.86%	-
东方证券股份有限公司	1	107,651,018.57	1.90%	100,255.72	1.90%	-
东北证券股份有限公司	1	102,933,409.68	1.81%	95,861.81	1.81%	-
长城证券股份有限公司	2	75,280,696.07	1.33%	70,107.94	1.33%	-
东方财富证券股份有限公司	2	51,325,268.41	0.90%	47,797.65	0.90%	-
国信证券股份有限公司	2	43,362,395.78	0.76%	40,382.52	0.76%	-
中银国际证券股份有限公司	1	39,635,922.94	0.70%	36,913.42	0.70%	-
汇丰前海证券有限责任公司	1	36,677,613.89	0.65%	34,157.43	0.65%	-
天风证券股份有限公司	1	25,879,347.19	0.46%	24,101.33	0.46%	-

渤海证券股 份有限公司	1	12,689,722.79	0.22%	11,818.29	0.22%	本期 退租 1 个
方正证券股 份有限公司	1	3,780,412.02	0.07%	3,520.77	0.07%	-
中国国际金 融股份有限 公司	1	30,955.63	0.00%	28.82	0.00%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

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
中信建投 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券 股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
光大证券股份有限公司						
广发证券股份有限公司	206,225.00	40.10%				
长江证券股份有限公司	192,195.74	37.37%				
西部证券股份有限公司						
招商证券股份有限公司						
中信证券股份有限公司	115,920.10	22.54%				
国泰君安证券股份有限公司						
华创证券有限责任公司						
安信证券股份有限公司						
东方证券股份有限公司						
东北证券股份有限公司						
长城证券股份有限公司						
东方财富证券股份有限公司						
国信证券股份有限公司						
中银国际						

证券股份 有限公司						
汇丰前海 证券有限 责任公司						
天风证券 股份有限 公司						
渤海证券 股份有限 公司						
方正证券 股份有限 公司						
中国国际 金融股份 有限公司						

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旗下部分基金参加财通证券股份有限公司申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
4	景顺长城基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统招行直联渠道基金交易费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-20
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
6	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-05
8	景顺长城基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-09
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-25
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报刊及	2021-03-15

	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	网站	
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-20
13	关于旗下部分基金新增阳光人寿保险股份有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-25
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-26
15	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
17	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-30
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
19	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-12
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-15
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-19
22	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-20
23	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
24	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
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-23
26	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
27	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-20
28	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2021 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-28
29	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-28
30	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-04

31	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-15
32	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2021 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
33	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金托管协议更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
34	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
35	景顺长城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
36	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-09
37	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
38	关于旗下部分基金新增广东南粤银行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	2021-07-16
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	2021-07-16
40	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-20
41	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
42	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-21
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	2021-07-23
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	2021-07-27
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	2021-08-06
46	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
47	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
48	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-23
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	2021-08-27
50	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

51	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华侨永亨银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-17
52	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-12
53	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
54	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
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	2021-10-22
56	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
57	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-27
58	关于旗下部分基金新增宁波银行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同业基金销售平台申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-03
59	关于旗下部分基金新增江海证券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	2021-11-05
60	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上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
61	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
62	关于景顺长城量化小盘股票型证券投资基金新增上海银行为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-30
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	2021-12-03
64	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
65	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
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	2021-12-17

67	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
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	2021-12-24
69	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210903-20211214	-	81,662,969.48	26,630,991.92	55,031,977.56	14.43

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：

1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

- (1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；
- (2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- (3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- (4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；
- (5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；
- (6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

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

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