

景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城公司治理混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城公司治理混合
场内简称	无
基金主代码	260111
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 10 月 22 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	231,066,665.59 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com

基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所
------------	------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	2,140,319.44
本期利润	-47,330,933.72
加权平均基金份额本期利润	-0.2312
本期加权平均净值利润率	-14.93%
本期基金份额净值增长率	-14.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	92,099,955.14
期末可供分配基金份额利润	0.3986
期末基金资产净值	375,114,249.66
期末基金份额净值	1.623
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	361.50%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

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

3.2 基金净值表现

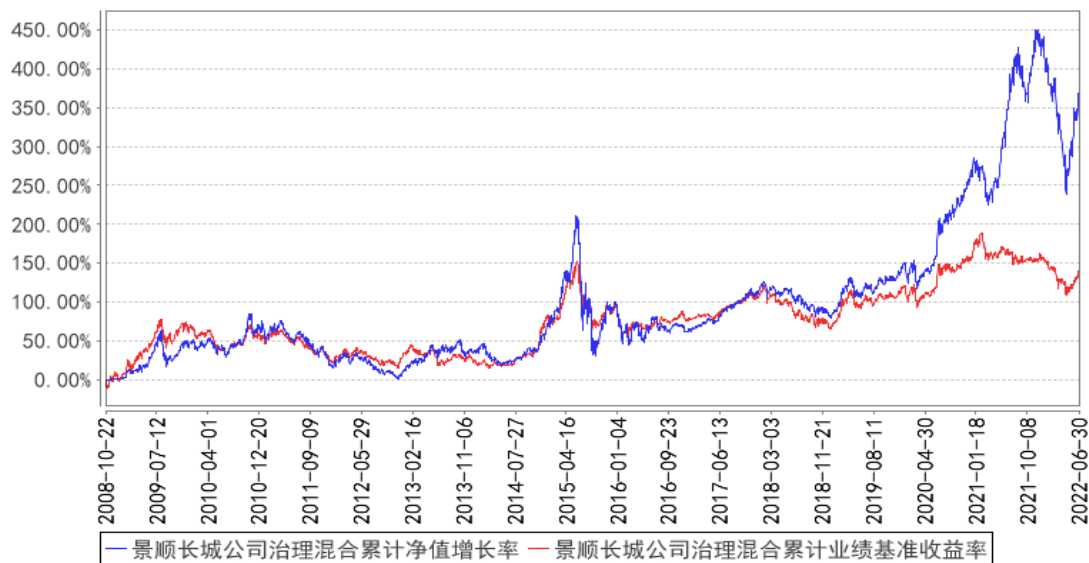
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	13.02%	1.97%	7.64%	0.86%	5.38%	1.11%
过去三个月	11.55%	2.27%	5.28%	1.14%	6.27%	1.13%

过去六个月	-14.69%	2.02%	-6.91%	1.16%	-7.78%	0.86%
过去一年	0.91%	1.76%	-10.31%	1.00%	11.22%	0.76%
过去三年	110.28%	1.43%	17.73%	1.01%	92.55%	0.42%
自基金合同生效起至今	361.50%	1.61%	139.39%	1.22%	222.11%	0.39%

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

景顺长城公司治理混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“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 2022 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 150 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨锐文	本基金的基金经理	2020 年 7 月 25 日	-	12 年	工学硕士、理学硕士。曾任上海常春藤衍生投资公司分析部高级分析师。2010 年 11 月加入本公司，担任研究部研究员，自 2014 年 10 月起担任股票投资部基金经理，现任股票投资部执行总监、基金经理。具有 12 年证券、基金行业从业经验。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城公司治理混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执

行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 27 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

上半年，欧美陷入战争与滞胀的漩涡中，悲观的阴霾笼罩着全球市场。受到海外市场的悲观情绪影响和国内疫情的冲击，A 股出现了巨幅波动，前 4 个月的灰暗时刻，到 5 月份的绝地反击，再到 6 月份的一枝独秀，A 股走出极其波动的半年。上半年，沪深 300、中小板指分别下跌 9.22%、11.56%，而创业板指表现更弱些，下跌 15.41%。

上半年，本基金录得负收益，并且跑输了基准。尽管全球经济充满不确定性，但是，我们对中国经济的相对优势以及我们投资的方向与组合充满信心。我们依然坚持投资具有伟大前景的新兴企业，并陪伴他们的成长，而不是趋势增强、寻求市场热点。我们相信未来的胜者一定是不断高强度投入的企业。尽管这些企业不一定是当前的焦点，但是，我们相信厚积薄发才能换取长期的发展。尽管这个过程充满艰难与痛苦，我们仍会坚持我们的选择和风格，我们也会不断优化和改进我们的持仓组合。本基金始终坚持投资于符合产业趋势的真正的成长股，基金仓位处于基金合同规定仓位限制中的高仓位（85%-95%）。

尽管当下的市场相对前期低点已经反弹了不少，后续的走向充满分歧，但是，我们的观点很明确，我们对未来一年的市场是乐观的。我们认为绝大多数的市场参与者，尤其是国际投资者，低估了中国经济的相对优势。这种相对优势主要体现在：（1）国内经济已经度过低谷，逐步向好，而欧美仍深陷在通胀和战争的泥潭中；（2）我们过去相对克制的经济政策与相对低通胀的环境，现在给我们带来足够的货币政策和财政政策空间。

从全球三大主要经济体对比来看，美国处于胀而不滞状态，欧洲则处于滞胀状态，中国则是滞而不胀。中国是全球少有依然能保持低通胀的经济体，因此，中国也是全球极少有能力继续保持宽松货币政策的经济体。随着中国不断加码经济刺激力度，中国将走向复苏的态势。然而，美国则面临着抑制通胀以及经济硬着陆的两难选择，尽管加息能缓解通胀压力，但是，稍有不慎则可能导致经济进入衰退。股市大跌则可能反作用于消费，经济进入负反馈的状态。另外，俄乌战争某种程度上损害了美元信用。按以往的规律来看，美债收益率从 1.5%上行到 3%以上，必然会带

来新兴市场暴跌，但是，此次则是例外。新兴市场的表现出奇的坚挺，这或许也说明了美国市场或者美元的吸引力在不断下降。

欧洲的情况则是更为糟糕，俄乌战争似乎是在不断消耗欧洲的资金和推升通胀。原油和天然气的价格暴涨，极大损害了欧洲的产业。欧洲化工产业出现了历史上第一次 C2 和 C3 裂解亏损，如果后面持续下去，少部分欧洲裂解的产能会被迫关停，导致 C2、C3 这些基础原料大幅涨价，从而导致欧洲其他下游化学品的全线涨价。同时，高油价也推升了运输成本快速上升。欧洲化工行业只是受影响产业的缩影之一，其他产业也在不同程度上受到影响。与此同时，能源价格暴涨挤压了欧洲老百姓的消费能力，这也让欧洲经济进一步走向负反馈。从去年荷兰的数据来看，天然气和水电等能源成本占普通老百姓的生活成本大概 13%，经过这轮能源价格暴涨之后，尽管政府有一定补贴，预计能源成本占普通老百姓的生活成本已经达到 20-30%。高通胀的负反馈已经全面影响欧洲的经济，这可能让欧洲面临越来越大的经济压力。

上面探讨了主要经济体的比较，我们认为中国资本市场可能会越来越有相对的吸引力。在全球面临高通胀的压力之时，全球经济可能更需要中国复苏的拉动，以及需要中国继续能为全球缓解通胀出一份力。俄乌战争及随后的经济制裁加剧了全球通胀，欧美的制裁非但没有影响到俄罗斯的出口，反而把欧洲拖入到滞胀的漩涡中。尽管俄罗斯的 GDP 只占全球 2% 不到，然而，西方试图通过制裁把俄罗斯剔除在全球供应链以外的举措，却让全球经济陷入到滞胀的阴霾里，欧洲深受其害。这某种程度上也说明了去全球化是极其艰难的，这次提前给欧美上了一堂课。因此，未来一段时间，鉴于全球经济的压力，中国的外围环境反倒可能出现边际的好转。

从国内的数据来看，5 月份的社融数据是超预期的，但是，数据的结构并不好。这意味着剩余流动性持续过剩，风险偏好不断上升，参考历史的经验，这种情形大概率是成长股行情。参考 2009 年年初的天量信贷，数据的结构一开始也是不好的，但是，随着时间的推移，结构是不断转好的。政府的逆周期操作必然会有时滞，这是不可避免的。7 月份，将近千万的大学生进入就业市场，这也让我们的就业压力会进一步加大，这也将促使政府需要进一步加大刺激力度以确保经济的平稳增长。经济复苏是确定的，剩余流动性过剩是持续的，美国加息带来的资金回流力度是边际减弱的，这种情形之下，市场大概率表现会好。

高通胀已经逐步演变成全球性的问题，除了中国以外，全球大部分国家均面临着高通胀的压力。这次高通胀的成因，一方面是需求端由于欧美过度刺激带来需求的非理性地增长，尤其美国疯狂印钱刺激消费；另一方面是供给端受到过去十年在能源、资源的资本支出严重不足、全球过于激进推进碳中和以及战争与疫情导致全球供应链效率大幅下降等因素影响。从全球角度来看，中国似乎就是例外。中国政府在过去这些年一直在做经济的逆周期调控，疫情的刺激政策也很克

制。尽管过去的保守政策思路未必是最好的，但是，今天似乎为我们带来更多的政策空间。另外，由于粮食和生活品基本自给自足，通胀压力主要体现在能源与原材料的输入性通胀，尽管我们原油的进口依存度很高，但是，我们的能源结构相对自主，因此，受到的影响相对可控。中国今天最大的问题还不是通胀压力，而是过去两年多的疫情对服务业造成的冲击，国内的内需不足带来的经济负反馈引发的种种问题。

今年以来，奥密克戎造成的疫情对消费带来巨大的冲击，月度社零数据出现连续的下滑，服务业遭受了全面的创伤。服务业的就业人口占比超过 45%，且大量的中小企业集中于服务业。按照总理的说法，中小企业正处于最困难的时刻。无论从就业人口角度还是中小企业纾困角度，加大经济刺激力度几乎是必然的。我们已经看到了各个地方陆续出台消费刺激政策以及各种中小企业纾困政策。我们倾向性地认为，尤其是以汽车、家电和手机等长产业链的消费行业的刺激政策会不断加码和扩散。毕竟，这些行业涉及了大量的制造业就业人群，还同时，关联了大量的消费服务业。从政策的乘数效应来说，这些行业的刺激也会带来最好的效果，而且，这些行业的产业链均在中国。

尽管疫情对我们的服务业带来严重的挑战，但是，中国消费的韧性是比我们预想中更强的，并且，在这种相对不利的环境之下，我们看到了消费龙头企业依旧不断在提升市场份额。随着疫情的缓解以及消费刺激政策陆续出台，我们相信这里面存在各种各样的机会。

在过去两年，我们越来越深刻感受到中国科技品牌的崛起，从手机端的华为、OPPO、VIVO、小米，到无人机的大疆，再到造车新势力的蔚小理等等，我们看到这些企业不仅在国内攻城掠地，同时也在海外快速扩张。在我们过去的印象中，我们的科技股主要是 2B 业务主导的零部件公司，很少有 2C 业务主导的产品型公司。但是，这几年，我们看到越来越多的企业走向微笑曲线的更上端，以设计研发、品牌为主，而不只是制造。在这轮疫情，我们也能看到这些科技品牌公司尽管国内业务受到疫情影响，但是，海外的业务依然高歌猛进。在过往，中国大部分成功的品牌型公司都是以强大的营销能力为主要的推动力，但是，营销的作用似乎已经大幅度降低，消费者更重视产品本身。我们现在很重视企业能否打造出让人震惊的创新性产品，是否能真正给消费者创造价值，并能向消费者传播价值。我们确信已经看到了越来越多中国公司做出了充满创新性且具有全球领先的产品，相信这些执着于产品本身的公司最终会展现出强大的爆发力。

关于中国优势的一些思考

即使在市场最糟糕的时候，我们依然从内心深处坚信，无论遇到多大的困难，我们中国人都能克服；我们深信，中国的制造业优势是无与伦比的，我们的劳动力整体素质和数量都是无可替代的。在 4 月疫情影响最严重的时候，当很多人看到越南高增长的出口数据就开始恐慌了，各种

中国制造崩溃论开始病毒式传播。实际上，越南更像是我们产业链的延伸，并不完全是替代。因此，越南 5 月以后的出口增速也同样受到中国疫情的制约。中国 90 年代的高校扩招为今天的经济发展提供了天量的工程师，这些都不是其他发展中国家能快速复制的。我们的优势不局限于完善的基础设施、全产业链优势，还有我们天量工程师的培养能力。厂房、公路、电厂、码头等基础设施的追赶可能只需要几年。但是，工程师的培养和整体劳动力素质的提升，没有 10 年-20 年的沉淀几乎是不可能实现的。这些优势给我们的科技发展和崛起争取了较长的时间窗口。

谈到科技的崛起，可能并没有很多投资者真正相信我们的科技。以至于，我们投资的过程中经常能听到各种质疑声。事实上，武断地拍脑袋，不仅无济于事，更有可能被过去的认知蒙蔽双眼，忽视了事物本身的发展。我们用三十年追赶其他国家的百年发展，我们的企业不可能一开始就是完美，都是处于不断进步和发展过程中。对于这些企业，如果我们只盯着它们的缺点，可能全部错过。大家可以感受一下中国汽车产业这些年的变化，感受一下国产车的进步，估计能更深刻体会到中国科技产业的进步。

拿半导体产业来说，今天的半导体产业和 2018 年的半导体产业相比已经是不可同日而语，无论是收入、利润还是产品线各方面。这只是过去了四年时间，如果再给四年时间，大概率发展速度会远超出我们的预期。对于科技的发展，比尔盖茨有句名言：人们往往高估一年的变化，低估十年的变革。我相信，很多人都会低估中国科技企业 5-10 年的发展速度和高度。毕竟，全世界很难找出像我们这样的民族那么崇尚奋斗，为了发展和生活，无数人愿意任劳任怨地奋斗。这样的奋斗也是过去我们制造业成功的基石，我们从未改变过。

我们深信中国科技必将崛起，我们也将矢志不渝地坚持投资中国的新兴科技股，希望能为中国科技产业的发展贡献绵薄之力。我们同样深信中国科技股也能和美国科技股一样为投资者带来丰厚的回报。我们做投资还是需要对未来乐观，悲观无济于事。换个角度来想，如果中国科技无法崛起，这几乎意味着中国无法跨越中等收入陷阱。如果我们陷入中等收入陷阱，也几乎不可能有什么行业能实现持续成长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2022 年上半年，本基金份额净值增长率为-14.69%，业绩比较基准收益率为-6.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们长期看好的方向

在全球大通胀的背景之下，未来几年的增量机会在减少，长期成长的机会可能变得更为稀缺与珍贵。站在当下，未来比较明确的主线方向无外乎三个方向：1、能源线；2、自主可控线；3、消费升级线。

首先，现在较为热门的原油、煤炭、风电、光伏、新能源车、储能等通通都属于能源线，这也是未来很长一段时间无法绕开的全球性问题，尤其在碳中和以及战争冲突的背景之下，能源的地位尤其重要。相对而言，我们更偏好于新能源，而非传统能源。对于传统能源，我们不知道怎么办给长期衰退型资产定价，对估值的把握充满忐忑，因此，我们对参与传统能源的机会相对谨慎。然而，我们更为热衷于风光车储这类型新能源资产，尤其是新能源车。叠加汽车智能化的趋势，新能源车无疑是未来十年最精彩的赛道。在去年底今年初，我们公开表示对新能源车相对谨慎，但是，站在当下，我们认为有必要更为乐观看待新能源车的发展。今年，我们看到越来越多有竞争力的新能源车产品推出，新能源车的体验相对于传统燃油车进一步拉开，渗透率的提升过程会比我们之前更为乐观。尤其现在处于政府逆周期刺激消费的过程中，新能源车明显受益，补贴力度的增加缓解了成本上涨以及消费萎靡的压力。与此同时，我们也看到越来越多车企加速推进车的智能化，在车上引入越来越多酷炫的功能。车不再是 A 点到 B 点的交通工具，已经被赋予更多层次的涵义。我们非常看好汽车智能化进程加速，我们认为现在只是车的智能化时代的开始，未来充满期待与想象。

其次，俄乌战争的爆发无疑让我们更清楚认识到自主可控的重要性，自主可控线包括半导体、设备、新材料、软件等等。由于我国是全球的制造工厂，也是这些产品的最大需求方，这意味着替代空间巨大。近期由于手机、笔记本、家电等产品的市场需求低迷，部分消费类芯片出现过剩，部分芯片的终端价格出现明显的下跌，这让很多投资者担忧半导体崩盘。实际上，半导体涨价本就是非常态，价格下降才是常态，但是，这些并不会影响半导体行业过去的高速成长。半导体是现代工业的原油，涉及到无数细分行业，芯片的种类多如牛毛，且不同产品的差异化很大。半导体不同于一般制造业，不同制程和或不同工艺的产能不完全能自由切换，这决定了供需过剩与结构短缺并存是常态。只要经济在发展，半导体永远都会有结构性机会。正如新能源高速成长推动功率半导体的需求爆发式增长，这并不会受到消费电子的需求低迷所影响。显然，功率半导体的扩产时间和难度远远高于新能源的其他环节。这种半导体的认知差将会带来各种各样的机会。除此之外，车规半导体、半导体设备和材料等领域预计同样会在未来很长一段时间保持高景气度。

最后，只要经济平稳发展，消费升级的趋势不会改变。消费升级远不止于白酒，还有各式各样的消费升级。我们尤其偏好于科技品牌崛起的机会。科技一直在改变我们的生活，我们看到中国科技公司推出越来越多有创新性的产品，同时我们也看到中国老百姓对国产科技品牌越来越接纳，这些都让我们深信中国科技品牌的崛起。

关于基金的策略容量

我们现在管理的优选、环保优势和创新成长等三支基金均定位为全行业基金，主要采取之前

季报所描述的企业生命力评估的方法论策略。它们不仅会投资在企业成长爆发阶段，也会有大量投资于陪伴企业成长的早中期阶段，市值分布从 30 亿至万亿不等，行业分布也较为分散，体现为多层次均衡式投资。

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

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

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

结束语

过去一个季度，市场情绪有所恢复，但是，依然不少人担忧与恐慌。我们此刻依然充满信心，虽然估值已经修复了不少，但是，我们认为市场依然低估了中国经济的相对优势，低估了中国科技的变化与进步。我深信，只要坚守在正确的产业方向和优秀的企业上，基金终将会为投资者带来丰厚的回报。我们也会努力做好，希望不辜负投资者的期待。面对百年不遇的变局，资本市场势必动荡加大，面对未来的风浪，我们努力把稳船舵，破浪前行。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施了一次利润分配。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金可供分配利润 114,976,841.98 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 57,488,420.99 元，本基金的基金管理人已于 2022 年 1 月 14 日完成权益登记，每 10 份基金份额派发红利 3.8 元，详细信息请查阅相关分红公告。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城公司治理混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	26,945,675.90	27,921,216.62
结算备付金		251,250.52	225,153.81
存出保证金		68,228.44	65,874.75
交易性金融资产	6.4.7.2	348,432,793.95	323,976,351.15
其中：股票投资		348,432,793.95	323,976,351.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		1,136,664.40	94,153.14
应收股利		-	-
应收申购款		1,817,622.12	635,456.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	2,688.25
资产总计		378,652,235.33	352,920,894.55
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,173,779.75	-
应付赎回款		1,499,226.82	890,701.83
应付管理人报酬		438,202.32	439,876.96
应付托管费		73,033.73	73,312.81
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	353,743.05	404,372.15
负债合计		3,537,985.67	1,808,263.75
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	231,066,665.59	151,615,996.55
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	144,047,584.07	199,496,634.25
净资产合计		375,114,249.66	351,112,630.80
负债和净资产总计		378,652,235.33	352,920,894.55

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.623 元，基金份额总额 231,066,665.59 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城公司治理混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-44,482,574.09	41,607,677.48
1. 利息收入		49,327.30	45,856.56
其中：存款利息收入	6.4.7.9	49,327.30	45,262.51
债券利息收入		-	594.05
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）		4,851,432.63	27,094,249.02
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,662,122.01	26,514,930.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	86,678.70	86,142.32
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	1,102,631.92	493,175.94
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-

其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-49,471,253.16	14,286,063.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	87,919.14	181,508.30
减：二、营业总支出		2,848,359.63	2,398,207.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,347,454.30	1,413,629.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	391,242.36	235,604.89
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.22	2.11
8. 其他费用	6.4.7.16	109,662.75	748,971.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-47,330,933.72	39,209,470.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-47,330,933.72	39,209,470.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-47,330,933.72	39,209,470.02

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城公司治理混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	151,615,996.55	-	199,496,634.25	351,112,630.80
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	151,615,996.55	-	199,496,634.25	351,112,630.80

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	79,450,669.04	-	-55,449,050.18	24,001,618.86
(一)、综合收益总额	-	-	-47,330,933.72	-47,330,933.72
(二)、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)	79,450,669.04	-	50,170,700.09	129,621,369.13
其中：1. 基金申购款	120,992,713.77	-	72,697,859.42	193,690,573.19
2. 基金赎回款	-41,542,044.73	-	-22,527,159.33	-64,069,204.06
(三)、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)	-	-	-58,288,816.55	-58,288,816.55
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	231,066,665.59	-	144,047,584.07	375,114,249.66
项目	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	136,528,754.38	-	122,427,969.92	258,956,724.30
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	136,528,754.38	-	122,427,969.92	258,956,724.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,769,685.16	-	945,575.33	-6,824,109.83
(一)、综合收益总额	-	-	39,209,470.02	39,209,470.02
(二)、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)	-7,769,685.16	-	897,995.91	-6,871,689.25
其中：1. 基金申购款	77,966,500.30	-	55,043,420.06	133,009,920.36
2. 基金赎回款	-85,736,185.46	-	-54,145,424.15	-139,881,609.61
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-39,161,890.60	-39,161,890.60
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	128,759,069.22	-	123,373,545.25	252,132,614.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2022 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外,本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标,且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致,即在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益:

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具,以公允价值计量且其变动计入当期损

益。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为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.2 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失

准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.3 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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》及《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”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外, 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定, 本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额, 2021 年度可比期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款, 金额分别为 27,921,216.62 元、225,153.81 元、65,874.75 元、2,688.25 元、94,153.14 元和 635,456.83 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款, 金额分别为 27,923,773.97 元、225,255.11 元、65,904.35 元、0.00 元、94,153.14 元和 635,456.83 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 323,976,351.15 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 323,976,351.15 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 890,701.83 元、439,876.96 元、73,312.81 元、212,311.08 元和 3,061.07 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 890,701.83 元、439,876.96 元、73,312.81 元、212,311.08 元和 3,061.07 元。

于 2021 年 12 月 31 日, “银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日, 根据新金融工具准则下的计量类别, 将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖

出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利

收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	26,945,675.90
等于：本金	26,943,098.10
加：应计利息	2,577.80
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1 个月(含)-3 个月	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	26,945,675.90

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	342,831,800.35	-	348,432,793.95	5,600,993.60
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	342,831,800.35	-	348,432,793.95	5,600,993.60

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,943.01
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	250,539.89
其中：交易所市场	250,539.89
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	98,260.15

合计	353,743.05
----	------------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	151,615,996.55	151,615,996.55
本期申购	120,992,713.77	120,992,713.77
本期赎回（以“-”号填列）	-41,542,044.73	-41,542,044.73
本期末	231,066,665.59	231,066,665.59

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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
本期期初	114,976,841.98	84,519,792.27	199,496,634.25
本期利润	2,140,319.44	-49,471,253.16	-47,330,933.72
本期基金份额交易产生的变动数	33,271,610.27	16,899,089.82	50,170,700.09
其中：基金申购款	50,573,155.60	22,124,703.82	72,697,859.42
基金赎回款	-17,301,545.33	-5,225,614.00	-22,527,159.33
本期已分配利润	-58,288,816.55	-	-58,288,816.55
本期末	92,099,955.14	51,947,628.93	144,047,584.07

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	活期存款利息收入	45,292.82
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	3,497.37	
其他	537.11	
合计	49,327.30	

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	卖出股票成交总额	265,897,476.24
减：卖出股票成本总额	261,351,004.14	
减：交易费用	884,350.09	
买卖股票差价收入	3,662,122.01	

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	55.55
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	86,623.15
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	86,678.70

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	335,680.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	249,000.00
减：应计利息总额	57.30
减：交易费用	0.35
买卖债券差价收入	86,623.15

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,102,631.92
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,102,631.92

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-49,471,253.16
股票投资	-49,471,253.16
债券投资	-
资产支持证券投资	-

基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-49,471,253.16

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	83,205.84
基金转换费收入	4,713.30
合计	87,919.14

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	18,600.00
银行划款手续费	490.00
存托服务费	1,312.60
合计	109,662.75

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

银行”)	
长城证券股份有限公司(“长城证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
长城证券	5,075,807.00	0.86	1,054,808.14	0.26

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30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	4,727.19	0.86	4,727.19	1.89
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
长城证券	982.40	0.26	-	-

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,347,454.30	1,413,629.02
其中：支付销售机构的客户维护费	631,166.39	366,932.29

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的托管费	391,242.36		235,604.89

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：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金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。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期	26,945,675.90	45,292.82	25,707,721.92	42,696.58

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2022年1月14日	2022年1月14日	3.800	29,473,537.04	28,815,279.51	58,288,816.55	-
合计			3.800	29,473,537.04	28,815,279.51	58,288,816.55	-

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股流通受限	63.10	39.85	176	11,105.60	7,013.60	-
301112	信邦智能	2022年6月20日	6个月	新股流通受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301123	奕东电子	2022年1月14日	6个月	新股流通受限	37.23	25.39	317	11,801.91	8,048.63	-
301125	腾亚精工	2022年5月27日	6个月	新股流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	38.46	38.46	4,424	170,147.04	170,147.04	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	38.46	38.46	492	18,922.32	18,922.32	-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	38.39	23.90	464	17,812.96	11,089.60	-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	新股流通受限	30.82	21.46	403	12,420.46	8,648.38	-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新股流通受限	33.68	43.98	323	10,878.64	14,205.54	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301160	翔楼新材	2022年5月25日	6个月	新股流通受限	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301162	国能日新	2022年4月19日	6个月	新股流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301163	宏德股份	2022年4月11日	6个月	新股流通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301187	欧圣电气	2022年4月13日	6个月	新股流通受限	21.33	22.54	730	15,570.90	16,454.20	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	122	7,817.76	4,577.44	-

301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	200	15,312.00	10,384.00	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	205	11,660.40	11,566.10	-
301212	联盛化学	2022年4月7日	6个月	新股流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	3,863	14,679.40	24,684.57	-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	360	12,844.80	10,742.40	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	173.98	87.82	60	10,438.80	5,269.20	-
301219	腾远钴业	2022年5月24日	4个月	新股流通受限-转增	-	87.82	48	-	4,215.36	-
301220	亚香股份	2022年6月15日	6个月	新股流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股流通受限	33.98	28.96	324	11,009.52	9,383.04	-
301228	实朴检测	2022年1月21日	6个月	新股流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股流通受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股流通受限	19.18	32.07	949	18,201.82	30,434.43	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股流通受限	33.65	33.65	3,965	133,422.25	133,422.25	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	441	14,839.65	14,839.65	-
301248	杰创智能	2022年4月13日	6个月	新股流通受限	39.07	29.87	413	16,135.91	12,336.31	-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,632	13,137.60	16,450.56	-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	48.30	41.68	217	10,481.10	9,044.56	-
301259	艾布鲁	2022年4月18日	6个月	新股流通受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	新股流通受限	19.93	31.38	581	11,579.33	18,231.78	-
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月	新股流通受限	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	453	12,910.50	15,796.11	-
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301298	东利机械	2022年5月27日	6个月	新股流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	新股流通受限	52.03	56.42	286	14,880.58	16,136.12	-
688052	纳芯微	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	230.00	350.81	957	220,110.00	335,725.17	-
688115	思林杰	2022年3月7日	6个月	新股流通受限	65.65	38.46	2,067	135,698.55	79,496.82	-
688237	超卓航科	2022年6月24日	1个月内(含)	新股流通受限	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688322	奥比中光	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	30.99	30.99	7,479	231,774.21	231,774.21	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股流通受限	21.93	21.93	6,284	137,808.12	137,808.12	-

注：受限期内，本基金因上市公司发生股票红利、送股、资本公积转增股本、配股等权益行为获取的衍生股份，亦应遵守相关股份的受限安排。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	26,945,675.90	-	-	-	-	-	26,945,675.90
结算备付金	251,250.52	-	-	-	-	-	251,250.52
存出保证金	68,228.44	-	-	-	-	-	68,228.44
交易性金融资产	-	-	-	-	-	348,432,793.95	348,432,793.95
应收申购款	-	-	-	-	-	1,817,622.12	1,817,622.12
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,136,664.40	1,136,664.40
资产总计	27,265,154.86	-	-	-	-	351,387,080.47	378,652,235.33
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,499,226.82	1,499,226.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	438,202.32	438,202.32
应付托管费	-	-	-	-	-	73,033.73	73,033.73
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,173,779.75	1,173,779.75
其他负债	-	-	-	-	-	353,743.05	353,743.05
负债总计	-	-	-	-	-	3,537,985.67	3,537,985.67
利率敏感度缺口	27,265,154.86	-	-	-	-	-	-
上年度末 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	27,921,216.62	-	-	-	-	27,921,216.62
结算备付金	225,153.81	-	-	-	-	225,153.81
存出保证金	65,874.75	-	-	-	-	65,874.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-323,976,351.15	323,976,351.15
应收利息	-	-	-	-	2,688.25	2,688.25
应收申购款	-	-	-	-	635,456.83	635,456.83
应收证券清算款	-	-	-	-	94,153.14	94,153.14
资产总计	28,212,245.18	-	-	-	-324,708,649.37	352,920,894.55
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	890,701.83	890,701.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	439,876.96	439,876.96
应付托管费	-	-	-	-	73,312.81	73,312.81
应付交易费用	-	-	-	-	212,311.08	212,311.08
其他负债	-	-	-	-	192,061.07	192,061.07
负债总计	-	-	-	-	1,808,263.75	1,808,263.75
利率敏感度缺口	28,212,245.18	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	348,432,793.95	92.89	323,976,351.15	92.27
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	348,432,793.95	92.89	323,976,351.15	92.27

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）	
分析	沪深 300 指数上升 5%	23,606,840.86	15,901,226.92
	沪深 300 指数下降 5%	-23,606,840.86	-15,901,226.92

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	346,619,147.66	321,917,102.65
第二层次	891,660.68	2,059,248.50
第三层次	921,985.61	-
合计	348,432,793.95	323,976,351.15

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	348,432,793.95	92.02
	其中：股票	348,432,793.95	92.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	27,196,926.42	7.18
8	其他各项资产	3,022,514.96	0.80
9	合计	378,652,235.33	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	313,297,542.72	83.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	18,231.78	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	14,959,424.02	3.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,559,890.58	3.61
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	5,795,411.33	1.54
N	水利、环境和公共设施管理业	654,031.62	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	148,261.90	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	348,432,793.95	92.89

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600460	士兰微	466,700	24,268,400.00	6.47
2	688169	石头科技	38,589	23,797,836.30	6.34
3	002841	视源股份	257,000	19,357,240.00	5.16
4	689009	九号公司	429,366	19,106,787.00	5.09
5	300207	欣旺达	520,421	16,445,303.60	4.38
6	688213	思特威	270,171	15,483,500.01	4.13
7	600745	闻泰科技	178,300	15,175,113.00	4.05
8	688002	睿创微纳	378,738	15,043,473.36	4.01
9	002352	顺丰控股	268,042	14,959,424.02	3.99
10	600150	中国船舶	755,900	14,346,982.00	3.82
11	688116	天奈科技	70,490	11,946,645.20	3.18
12	002472	双环传动	372,000	11,844,480.00	3.16
13	601208	东材科技	803,550	10,381,866.00	2.77
14	002126	银轮股份	878,100	10,054,245.00	2.68
15	688667	菱电电控	58,514	8,451,177.02	2.25

16	002709	天赐材料	135,000	8,378,100.00	2.23
17	688326	经纬恒润	56,485	8,306,684.10	2.21
18	688518	联赢激光	237,894	8,086,017.06	2.16
19	688187	时代电气	122,571	7,965,889.29	2.12
20	002906	华阳集团	173,753	7,872,748.43	2.10
21	688696	极米科技	22,657	6,975,410.59	1.86
22	688111	金山办公	33,076	6,519,941.12	1.74
23	600989	宝丰能源	438,600	6,425,490.00	1.71
24	688099	晶晨股份	63,431	6,406,531.00	1.71
25	300627	华测导航	169,700	5,835,983.00	1.56
26	688248	南网科技	248,585	5,747,285.20	1.53
27	688007	光峰科技	212,968	5,175,122.40	1.38
28	300035	中科电气	164,800	4,606,160.00	1.23
29	002409	雅克科技	82,200	4,562,922.00	1.22
30	688019	安集科技	20,184	4,297,577.28	1.15
31	300790	宇瞳光学	209,190	3,999,712.80	1.07
32	688082	盛美上海	40,494	3,837,616.38	1.02
33	003031	中瓷电子	58,660	3,789,436.00	1.01
34	688499	利元亨	15,807	3,498,089.10	0.93
35	688167	炬光科技	19,523	2,904,046.25	0.77
36	000888	峨眉山 A	68,800	630,896.00	0.17
37	688052	纳芯微	957	335,725.17	0.09
38	688322	奥比中光	7,479	231,774.21	0.06
39	301139	元道通信	4,916	189,069.36	0.05
40	301239	普瑞眼科	4,406	148,261.90	0.04
41	688400	凌云光	6,284	137,808.12	0.04
42	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.03
43	688115	思林杰	2,067	79,496.82	0.02
44	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
45	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
46	301035	润丰股份	390	32,155.50	0.01
47	301238	瑞泰新材	949	30,434.43	0.01
48	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.01
49	688083	中望软件	127	26,596.34	0.01
50	301215	中汽股份	3,863	24,684.57	0.01
51	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.01
52	301263	泰恩康	581	18,231.78	0.00
53	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
54	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
55	301187	欧圣电气	730	16,454.20	0.00
56	301256	华融化学	1,632	16,450.56	0.00
57	301302	华如科技	286	16,136.12	0.00

58	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
59	301268	铭利达	453	15,796.11	0.00
60	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
61	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
62	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
63	301153	中科江南	323	14,205.54	0.00
64	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
65	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
66	301248	杰创智能	413	12,336.31	0.00
67	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
68	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
69	301207	华兰疫苗	205	11,566.10	0.00
70	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
71	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
72	301148	嘉戎技术	464	11,089.60	0.00
73	301216	万凯新材	360	10,742.40	0.00
74	301200	大族数控	200	10,384.00	0.00
75	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
76	301219	腾远钴业	108	9,484.56	0.00
77	301222	浙江恒威	324	9,383.04	0.00
78	301258	富士莱	217	9,044.56	0.00
79	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
80	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
81	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
82	301151	冠龙节能	403	8,648.38	0.00
83	301123	奕东电子	317	8,048.63	0.00
84	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
85	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
86	301110	青木股份	176	7,013.60	0.00
87	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
88	301196	唯科科技	122	4,577.44	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	689009	九号公司	15,124,906.89	4.31
2	600150	中国船舶	14,597,375.00	4.16
3	688169	石头科技	14,469,221.47	4.12
4	300207	欣旺达	13,827,364.23	3.94
5	688213	思特威	13,047,275.19	3.72
6	688082	盛美上海	11,178,467.12	3.18

7	688099	晶晨股份	10,291,954.98	2.93
8	600460	士兰微	10,253,641.00	2.92
9	300709	精研科技	9,418,578.28	2.68
10	688518	联赢激光	9,023,959.06	2.57
11	600745	闻泰科技	8,539,261.00	2.43
12	688667	菱电电控	7,957,963.04	2.27
13	688002	睿创微纳	7,803,462.30	2.22
14	688007	光峰科技	7,614,599.76	2.17
15	002841	视源股份	7,541,961.00	2.15
16	688326	经纬恒润	7,360,881.00	2.10
17	688187	时代电气	7,067,713.70	2.01
18	002709	天赐材料	7,001,972.00	1.99
19	002472	双环传动	6,886,760.00	1.96
20	002126	银轮股份	6,630,863.00	1.89

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002049	紫光国微	15,744,472.72	4.48
2	300790	宇瞳光学	13,745,719.00	3.91
3	600418	江淮汽车	10,757,376.00	3.06
4	605111	新洁能	10,056,025.64	2.86
5	688798	艾为电子	9,438,177.81	2.69
6	688099	晶晨股份	9,237,931.79	2.63
7	300207	欣旺达	9,184,988.65	2.62
8	688150	莱特光电	9,180,820.36	2.61
9	600210	紫江企业	8,926,939.00	2.54
10	300709	精研科技	7,900,538.50	2.25
11	688082	盛美上海	7,748,400.05	2.21
12	002409	雅克科技	7,045,926.00	2.01
13	688007	光峰科技	6,830,987.61	1.95
14	688261	东微半导	6,668,394.91	1.90
15	300115	长盈精密	6,655,490.03	1.90
16	688268	华特气体	6,630,930.04	1.89
17	688167	炬光科技	6,218,825.02	1.77
18	603348	文灿股份	6,094,924.00	1.74
19	603197	保隆科技	5,797,065.00	1.65
20	688678	福立旺	5,450,015.88	1.55

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	335,278,700.10
卖出股票收入（成交）总额	265,897,476.24

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	68,228.44
2	应收清算款	1,136,664.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,817,622.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,022,514.96

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
20,759	11,130.92	5,979,540.40	2.59	225,087,125.19	97.41

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	13,143,938.95	5.688375

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008 年 10 月 22 日）	
基金份额总额	273,077,492.69
本报告期期初基金份额总额	151,615,996.55
本报告期基金总申购份额	120,992,713.77
减：本报告期基金总赎回份额	41,542,044.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	231,066,665.59

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	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	佣金	占当期佣金总量的	

	元数量		交总额的 比例 (%)		比例(%)	
中银国际证券股份有限公司	1	83,299,842.02	14.05	77,659.57	14.06	-
华西证券股份有限公司	1	81,654,563.08	13.78	76,080.71	13.77	-
东方财富证券股份有限公司	2	57,516,361.57	9.70	53,606.95	9.71	-
中信证券股份有限公司	3	43,550,779.75	7.35	40,558.80	7.34	-
民生证券股份有限公司	1	33,735,966.23	5.69	31,495.52	5.70	-
中航证券股份有限公司	2	28,490,821.63	4.81	26,554.77	4.81	本期新增 1 个
华创证券有限责任公司	1	27,359,063.79	4.62	25,480.32	4.61	-
方正证券股份有限公司	2	27,069,543.36	4.57	25,210.00	4.56	-
中国国际金融股份有限公司	2	25,693,139.29	4.33	23,945.53	4.34	-
国海证券股份有限公司	1	23,659,471.78	3.99	22,034.84	3.99	-
中信建投证券股份有限公司	2	18,257,016.11	3.08	17,011.84	3.08	-
兴业证券股份有限公司	1	18,165,842.66	3.06	16,918.01	3.06	-
国泰君安证券股份有限公司	1	17,938,805.31	3.03	16,707.16	3.02	-
国盛证券有限责任公司	1	17,382,592.57	2.93	16,188.40	2.93	-
东方证券股份有限公司	3	14,833,282.71	2.50	13,814.27	2.50	-
东亚前海证券有限责任公司	1	14,618,162.54	2.47	13,613.88	2.46	-
海通证券股份有限公司	1	11,359,962.28	1.92	10,579.66	1.92	-
瑞银证券有限责任公司	1	9,334,328.26	1.57	8,693.15	1.57	-
广发证券股份有限公司	1	7,782,446.95	1.31	7,260.50	1.31	-
天风证券股份有限公司	1	6,009,354.71	1.01	5,596.61	1.01	-
太平洋证券股份有限公司	1	5,624,941.66	0.95	5,238.67	0.95	-
北京高华证券有限责任公司	1	5,177,296.97	0.87	4,821.65	0.87	-
长城证券股份有限公司	1	5,075,807.00	0.86	4,727.19	0.86	-
国金证券股份有限公司	1	4,577,841.00	0.77	4,265.00	0.77	-
中泰证券股份有限公司	1	4,091,047.22	0.69	3,809.88	0.69	-
申万宏源证券有限公司	1	310,449.93	0.05	295.32	0.05	-
国都证券股份有限公司	1	176,203.00	0.03	164.15	0.03	-
安信证券股份有限公司	1	17,473.39	0.00	16.27	0.00	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞信证券(中国)有限公司	2	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	4	-	-	-	-	本期新增 1 个
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

a、资金实力雄厚，信誉良好；

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

2) 选择程序

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	335,680.80	100.00	-	-	-	-
中航证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞信证券（中国）有限公司	-	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-01
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-01
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行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	2022-01-01
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2022 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-01
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富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	2022-01-07
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	2022-01-07
7	关于景顺长城公司治理混合型证券投资	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-11

	资基金暂停接受壹仟元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告		
8	景顺长城公司治理混合型证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-12
9	关于景顺长城公司治理混合型证券投资基金限制接受壹仟元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-17
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	2022-01-20
11	景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-24
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-24
13	关于旗下部分基金参加中国人寿保险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	2022-01-25
14	关于景顺长城公司治理混合型证券投资基金暂停接受拾万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-27
15	景顺长城基金管理有限公司关于投资旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-27
16	关于景顺长城公司治理混合型证券投资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基金申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-28
17	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	2022-02-18
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	2022-02-25
19	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	2022-03-04
20	关于旗下部分基金参加西部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	2022-03-10
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-28
22	景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-28
23	景顺长城基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司和北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-01

	下基金相关销售业务的公告		
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机升级的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-08
25	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-12
26	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-16
27	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
28	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
29	景顺长城基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯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	2022-04-22
30	景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
31	景顺长城基金管理有限公司关于终止上海朝阳永续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	2022-04-27
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	2022-04-29
33	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	2022-05-06
34	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	2022-05-12
35	关于旗下部分基金新增攀赢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	2022-05-26
36	景顺长城基金管理有限公司关于暂停腾元基金、汇付基金、南京途牛和有鱼基金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	2022-05-26
37	关于旗下部分基金新增华金证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-30
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	2022-06-10
39	景顺长城公司治理混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-16
40	关于旗下部分基金参加申万宏源证券和申万宏源西部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	2022-06-22

41	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信百信银行为销售机构并开通基金“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	2022-06-23
42	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日