

# 景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 23 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	18
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 .....	18
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	19
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	19
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>19</b>
6.1 资产负债表 .....	19
6.2 利润表 .....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	21
6.4 报表附注 .....	23
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	43
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 .....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	48

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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>57</b>
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 .....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城环保优势股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城环保优势股票
基金主代码	001975
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 月 15 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	1,721,659,584.41 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金依托景顺长城研究团队的研究成果，持续深度挖掘具有环保优势的上市公司，分享其在中国经济增长的大背景下的绿色、高效可持续增长，以实现基金资产的长期资本增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略：本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>2、股票投资策略：本基金通过定性与定量相结合的积极投资策略，自下而上地精选价值被低估并且具有良好基本面的具备环保优势的股票构建投资组合。</p> <p>（1）环保优势企业的界定： 随着经济社会的发展，人类社会与环境的协调发展，生态环境的保护和建设日益重要。本基金将充分挖掘经济社会发展中具备 1、环保产业链优势；2、绿色经济优势；3、效率社会优势；4、可持续发展优势的四大环保优势企业的主题投资机会，通过投资以上主题企业，推动经济社会发展与环境保护矛盾得到有效化解，推动人类社会与自然环境和谐共存。</p> <p>（2）个股投资策略： 按照上述“环保优势企业的界定”中，本基金将采取“自下而上”的方式，依靠定量与定性相结合的方法精选个股，充分发挥基金管理人的研究优势，利用基金管理人股票研究数据库（SRD）对企业内在价值进行深入细致的分析，并进一步挖掘出具有竞争优势的上市公司股票进行投资。</p> <p>3、债券投资策略：债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>4、中小企业私募债投资策略：对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金将加强自下而</p>

	上的分析, 将机构评级与内部评级相结合, 着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力, 尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。
业绩比较基准	中证环保产业指数收益率*40% + 沪深 300 指数收益率*40% + 中证全债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型基金, 属于证券投资基金中风险程度较高的投资品种, 其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皦阳	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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

### 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	423,941,192.30
本期利润	724,105,353.06
加权平均基金份额本期利润	0.4206
本期加权平均净值利润率	13.01%

本期基金份额净值增长率	13.49%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	2,635,119,209.10
期末可供分配基金份额利润	1.5306
期末基金资产净值	6,559,735,392.64
期末基金份额净值	3.810
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	281.00%

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

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

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

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

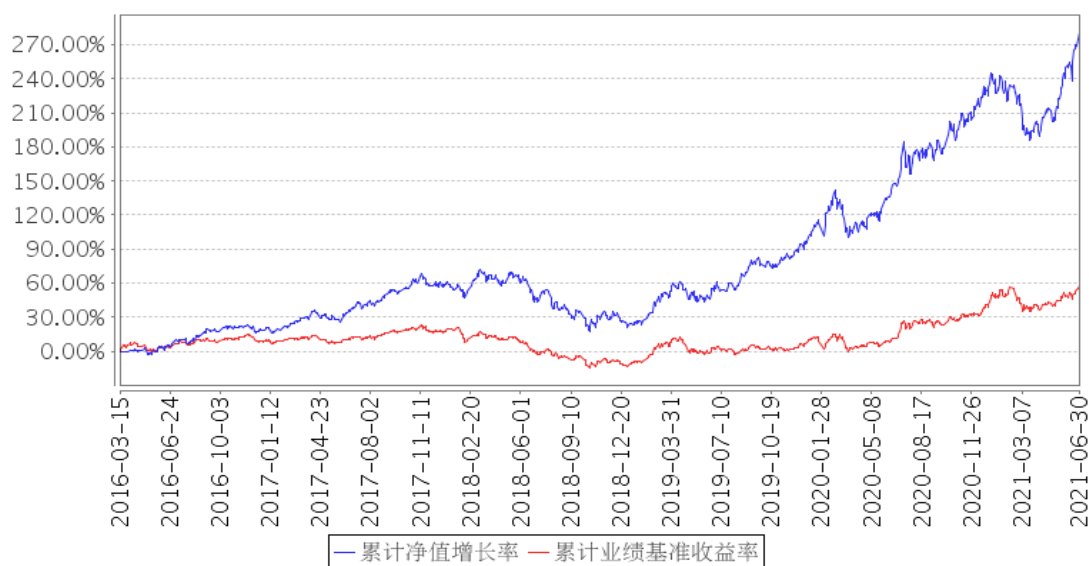
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	10.31%	1.50%	3.91%	0.96%	6.40%	0.54%
过去三个月	29.81%	1.31%	12.89%	0.94%	16.92%	0.37%
过去六个月	13.49%	1.43%	9.72%	1.27%	3.77%	0.16%
过去一年	52.89%	1.48%	39.46%	1.22%	13.43%	0.26%
过去三年	157.78%	1.47%	55.87%	1.17%	101.91%	0.30%
自基金合同生效起至今	281.00%	1.28%	57.13%	1.01%	223.87%	0.27%

### 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

景顺长城环保优势股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：本基金将基金资产的 80%–95% 投资于股票资产，投资于具有环保优势的上市公司发行的股票占非现金资产的比例不低于 80%。权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，将基金资产的 5%–20% 投资于现金和债券等固定收益类品种，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。本基金的建仓期为自 2016 年 3 月 15 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。

### 3.3 其他指标

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截至 2021 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 124 只开放式基金，包括景



顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金 (LOF)、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金 (LOF)、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金 (QDII)、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小创精选股票型证券投资基金、景顺长城中证科技传媒通信 150 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证科技传媒通信 150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化小盘股票型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城

MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金、景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景泰鑫利纯债债券型证券投资基金、景顺长城智能生活混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金、景顺长城集英成长两年定期开放混合型证券投资基金、景顺长城量化港股通股票型证券投资基金、景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金、景顺长城绩优成长混合型证券投资基金、景顺长城中短债债券型证券投资基金、景顺长城中证沪港深红利成长低波动指数型证券投资基金、景顺长城稳健养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城创新成长混合型证券投资基金、景顺长城景泰纯利债券型证券投资基金、景顺长城养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城弘利 39 个月定期开放债券型证券投资基金、景顺长城品质成长混合型证券投资基金、景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、景顺长城泰申回报混合型证券投资基金、景顺长城科技创新混合型证券投资基金、景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金、景顺长城景泰裕利纯债债券型证券投资基金、景顺长城核心优选一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城创业板综指增强型证券投资基金、景顺长城成长领航混合型证券投资基金、景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城安鑫回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城弘远 66 个月定期开放债券型证券投资基金、景顺长城价值稳进三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城竞争优势混合型证券投资基金、景顺长城景泰添利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、景顺长城价值边际灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城电子信息产业股票型证券投资基金、景顺长城消费精选混合型证券投资基金、景顺长城景颐招利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城顺鑫回报混合型证券投资基金、景顺长城景泰宝利一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金、景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金、景顺长城核心中景一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、景顺长城核心招景混合型证券投资基金、景顺长城景泰恒利一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城产业趋势混合型证券投资基金、景顺长城景泰益利纯债债券型证券投资基金、景顺长城成长龙头一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城品质长青混合型证券投资基金、景顺长城新能源产业股票型证券投资基金、景顺长城安泽回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城泰源回报混合型证券投资基金、景顺长城景骊成长混合型证券投资基金、景顺长城安盈回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城景气成长混合型证券投资基金、景顺长城安益回报一年持有期混合型证券投资基金

金、景顺长城中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城颐心养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨锐文	本基金的基金经理	2016 年 3 月 15 日	-	11 年	工学硕士、理学硕士。曾任上海常春藤衍生投资公司分析部高级分析师。2010 年 11 月加入本公司，担任研究部研究员，自 2014 年 10 月起担任股票投资部基金经理，现任股票投资部执行总监、基金经理。具有 11 年证券、基金行业从业经验。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 7 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，全球新冠疫情不断反复，但流动性预期在好转，全球股市表现较佳，A 股也同样出现明显的反弹。基金重仓股出现明显分化，沪深 300、中小板指分别上涨 0.24%、3.66%，而创业板指表现则更为强势，上涨 17.22%。

上半年，我们之前坚守的很多个股表现较佳，带动了我们的基金跑赢基准。不管市场如何变化，我们依然坚持投资具有伟大前景的新兴产业企业，并伴随他们的成长，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，也会不断优化和改进持仓组合。本基金始终坚持投资于符合产业趋势的真正的成长股，基金仓位处于合同规定仓位的上限（88%-95%）。

我今年初表达了对市场的担忧（见 2020 年报），认为市场的机会并不是来自 5% 的高估值抱团股，更多来自于剩余的 95% 的股票，今年上半年的市场也的确是这样演进的。我们在今年一季报中对市场的看法从谨慎变为相对乐观，认为市场低估了经济基本面的强劲，高估了流动性的边际变化，而二季度的行情也如我们所判断一样演绎。

A 股是很情绪化的市场，长期坚持与独立思考是 A 股机构投资者重要的超额收益来源之一。我们也衷心希望我们的持有人也能秉承长期投资的理念，不要把基金当成短期投资，毕竟基金的交易成本是很高的。我们渴望持有人的信任，也努力为持有人提供稳定的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年上半年，本基金份额净值增长率为 13.49%，业绩比较基准收益率为 9.72%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对未来的展望

我们依然对市场保持乐观。上半年的市场表现非常极端，核心资产之间也出现了明显分化，高估值的核心资产表现明显比相对低估的核心资产表现更好。市场为更长远的美好愿景付出了

更高的溢价。部分公司的估值透支了未来 5-10 年的空间，这种远期透支的模式总会有尽头。长期稳定的增长只是理想中的模型，实际经营过程中会有各种波折，极高的估值（百倍以上）的风险是一旦遭遇波折则会面临戴维斯双杀的局面。我们认为，下半年的风格依然是结构性的，更有可能的机会来自估值压抑多年的中小市值龙头与科创板。科创板经过两年的估值消化，逐步涌现出一批估值合理且高成长性的标的，这里面或许蕴藏着各种机会。

现在是最好的时候，也是最坏的时候。最好的时候是因为有很多便宜的优质中小市值股票，这些股票一直趴在底部一动不动，这给我们足够时间从容地选股。最坏的时候就是长期前景美好的股票过度透支远期空间，这也给市场带来一定的风险。

当然，市场的核心变量依然是新冠疫情的演变和流动性的变化。疫情对各国的生产和消费带来巨大的冲击和破坏，不断损伤各国居民的资产负债表。天量的放水，又进一步加剧了贫富差距，这体现在低迷的全社会零售与火热的奢侈品销售。从全球范围内来看，仍然看不到大幅回收流动性的可能性。在大水漫灌之下，大部分水还是流到池塘，然而，周边更广阔的高地依然是哺育不够的。这些广阔高地的干涸又反向制约了各国央行的政策空间，即使央行们试图轻踩刹车，但是，池塘中的流动性依然是充裕的。这些流动性会不断寻觅高收益资产，这会为市场带来各种各样的机会。当然，这种流动性的摆动也会加剧市场的波动率。

新冠疫情在印度近乎失控以及在东南亚全面蔓延，让全球制造业供应链处于失控的状态。全球的商品制造将更为倚重于中国，这个状态可能 2-3 年内难以改变。与此同时，国际大宗商品价格今年以来大幅上涨，这给中国制造业在过去半年带来极大的压力，企业普遍出现“增收不增利”的状态。因此，今年上半年的制造业股票表现普遍不佳。然而，事情正在发生变化。大宗原材料的涨价已经趋于缓和，国内制造业的成本传递机制也开始启动，更何况现阶段中国制造处于相对垄断的地位。过去一段时间，制造业的盈利能力与估值正如过度压紧的弹簧，在传导机制启动之后，会有非常明显的恢复性反弹。

与此同时，传统的经济增长模式暴露出越来越多问题，投资的政策风险事件频发。从高压的房地产政策，到互联网反垄断，到经营贷整治，然后到史上最严的教育培训新政，政府的关注点越来越聚焦在民生与社会内卷等问题上。现实的生育率问题也迫使政府努力为广大群众生活减负。效率与公平，逐步从效率优先过渡到兼顾公平。这可能会给投资带来一系列潜在的风险。

现在的投资环境越来越复杂，干扰因素越来越多，过去的成功范式不一定在未来有效，利润增长很好不一定意味着投资价值很高，或许更需要关注企业是否创造正面的社会价值。如果一个企业的利润增长很好，但是却有可能给社会带来负面影响（譬如贩卖焦虑、损伤就业），那么这样的企业的投资价值可能得到极大的折损；如果一个企业现阶段尚且无法实现持续的利润增长，但

他的发展将给社会带来巨大的正面意义（譬如供应链安全、节能减排），这样的企业的潜在投资价值可能很高。

我们看好的方向

半导体

我们在一季报中明确表达看好半导体，市场也正如我们判断那样演进。我们依然需要强调这次半导体的机会不是一次性机会，而是长期的机会。这次半导体不仅仅是缺芯带来的量价齐升，更重要的意义是中国半导体企业走向高端化的进程在加速。正因为这次前所未有的芯片危机，让很多中国芯片企业不同产品和领域出现零的突破，国产全面突围已经是无可争议的趋势。

很多人或许会认为现在的半导体估值非常贵，这很可能是从静态角度观测。从业绩角度上，无论是 IDM、代工厂还是芯片设计公司，成本往往是在前期刚性投入的，体现为大量的设备折旧或高额的研发人员薪酬等，需求的暴增对于边际成本的影响是很低的，这也就意味着业绩的增长往往是非线性的，用过去的盈利能力去判断容易造成低估；从估值角度上，国内半导体公司在很多领域和产品的市场份额还是很低，具有很大的成长空间，谈估值收缩为时尚早；从市值角度上，中国半导体公司超过千亿的数量依然是非常稀少的，而无论美国、欧洲还是日韩，都有不少千亿乃至万亿级别的半导体企业。

当然，这并不是说半导体没有泡沫。尤其在这次缺芯危机中，有些中小企业为了赚短平快的钱，大幅涨价或撕毁过去的合同赚取暴利。这是赚取一次性的钱，反倒可能是表面估值越便宜，泡沫越大的情形。真正具备长期投资价值的公司肯定会在紧缺与涨价中寻求个平衡点，在客户认可范围内涨价并实现更多产品的突围。

我们半导体的投资依然围绕着以下几个方面展开：

1、产能依然为王，优选功率半导体。尽管近期的比特币价格大幅回落以及中国大规模关闭比特币矿场，矿机的需求降至冰点，这对先进制程的需求紧张有所缓解，但很快又被其他应用迅速填充上。与之不同，功率半导体的需求取决于汽车、新能源、家电、电动工具等更广泛的需求，这些需求增长更为稳定。电动车以及光伏等清洁能源的爆发更是加速了功率半导体的需求增长。从供给端来看，由于二手 8 寸设备一台难求，且扩产周期长达 2.5-3 年，功率半导体的供给释放速度是缓慢的。供需失衡将持续较长时间，这对中国的 Fab 厂和 IDM 企业都是历史性机遇，尤其对于 IDM 企业更是产品走向高端化的关键窗口期。

2、技术壁垒与产品特性是芯片设计公司的选择关键。由于资本的疯狂追逐，这几年诞生了不少的初创型芯片设计公司。如果芯片的技术壁垒不是足够深厚，竞争格局很快会出现恶化。因此，芯片设计公司的技术壁垒评估尤其重要。另外，不同芯片设计公司的产品种类不一样，短周期产

品的爆发力更强，但是持续能力较弱。长周期产品的爆发力稍弱，但是持续能力较强。我们投资中更偏好有高技术壁垒的长周期产品的芯片设计公司。

3、随着 H 公司的晶圆厂逐步进入投产阶段，中国的半导体设备和材料公司将会面临历史性的机遇。由于半导体材料具有极高的技术壁垒和广阔的潜在市场空间，与芯片设计与半导体设备公司相比，同样估值的情况下，我们优选投资半导体材料公司。

以上分析仅是我们投资半导体的基本逻辑和框架，我们希望把我们对投资半导体的一些思考分享给我们的投资者。

### 电动智能汽车

今年以来，新能源汽车展开了轰轰烈烈的行情，一下子又从地狱回归到天堂。越来越多投资者认同电动智能化的大趋势是不可逆转的，尽管今天的估值已经不便宜，但是，电动车是少数可以通过爆发式增长消化高估值的行业。今天过热的方向仅仅是电动化，然而，电动智能化带来的改变并不局限于燃油变成电动，也会从简单的车机变成智能座舱，智能驾驶更是从无到有，且不断升级。这些的改变都会带来零部件的巨大变化：IGBT 的大幅度应用、车的含硅量成数倍上升、更多酷炫功能的推出（例如：ARHUD 等）... 今天，我们不仅需要思考电动化带来的变化，更要思考智能化带来的变化。鸿蒙 2 的横空出世，完美的多屏协同，同样给未来的车上娱乐带来无限的想象空间。

之前季报提到，我们投资电动智能汽车更重要的原因是：这是一场产业革命。与此同时，我们也看好它会成为新一代的入口级产品。成为入口级产品，前提必须是高频使用的产品。电视之所以不能成为家庭娱乐的入口级产品，核心是因为开机率是持续下降的，它无法承载入口的功能。智能手机之所以成为最重要的入口级产品，核心在于通信功能是日常最高频使用的功能，这让它天然具备个人智能终端的入口。然而，我们生活中真正高频使用的产品是很少的。我们每天都需要出行，都需要从 A 点到 B 点，那么，汽车是能满足高频使用场景的产品。因此，电动智能车是有机会成为继手机之后的新一代入口级产品。一旦成为入口级产品，汽车可能不只是定位为从 A 点到 B 点的出行工具，可能还会是办公中心、个人娱乐中心。汽车内部的封闭式空间更是有望成为沉浸式场景体验空间。自动驾驶又将释放个人的闲余时间，这对社会的生产效率也会是极大的促进。

市场有观点认为，自动驾驶之后汽车数量是下降的。我们不认同这种观点。共享汽车已经长期存在，共享与否并不是决定汽车数量的根本原因。人们买私家车的根本原因是私密与专属，显然，汽车智能化之后更是增强私密性与专属性，正如智能手机时代的保有量远远大于功能手机时代的保有量，当汽车不仅承载出行功能之后，汽车的数量只会增加不会减少。

如上面所分析，汽车市场需求大概率不会减少，甚至上升，且汽车又有望成为新一代的入口级产品，那么，汽车的市场空间或许不能以过去的方式度量。这里面可能诞生的机会可能更为多元化，现今还很难看得透彻。但是，毋庸置疑，这是前所未有的产业机会。

非常幸运的是中国的智能电动车产业链在起步阶段就具有全球竞争力，中国智能电动车产业链不仅完整地囊括了所有环节，还有足够大的规模，全球的汽车品牌基本上都在中国寻找供应商。这种产业链优势不仅仅体现在电动化层面，同样发生在智能化方面。去年推出的大众 ID4 的销量惨淡也反衬出国际车厂的智能化水平是与国内车厂有明显差距的。国际车厂在电动化的落后或许比我们预想还要糟糕，这对国内车厂都是明显的机会。这或许将开启中国汽车品牌正式走向世界之路，过去，中国的自主品牌售价一直被压制在 15 万及以下，中国车企在智能电动车上正式进入利润最丰厚的 20-50 万的市场，打破过去合资品牌和进口品牌在这个价位段的垄断。

从最近的新闻来看，不仅仅是华为，小米、阿里、百度等巨头都纷纷入局智能电动车领域，巨头们入局的时间点肯定是深思熟虑的，这个信心来自于中国智能电动化产业链的成熟程度。雷军说，小米汽车是他人生之中最后一次重大的创业，ALL in 人生全部的声誉。其实，我也有雷总一样的信心，坚信未来十年是中国智能电动车爆发的十年，这也会是我们未来最重要的投资领域。

#### 中小市值龙头及科创板

经过过去几年的估值消化，不少中小板市值龙头从过去的溢价变成严重折价。然而，这些公司依然保持不错的成长性。今年以来，简单的“以大为美”的风格似乎已经悄然发生变化。当市场简单以大小区分好坏，那么，中小市值的机会或许已经到来了。

同样的情况发生在科创板，科创板成立即将满两年，上市的公司已经超过 300 家，过去两年一直在消化过高的估值，正如当初创业板上市之后的前两年一直在消化估值。随着过去两年的募投项目逐步达产，这些公司的成长性或者进一步上移，市场的关注点有望再度回归。

#### 我们的投资选择

很多人都在说，希望赚利润增长的钱。但是，要赚取利润增长的钱，前提是估值不能下移。我们曾见证了 07 年-14 年，万科、招行、中集等著名的经典成长股进入长达 8 年的杀估值过程。虽然这几年是核心资产的行情，然而，对于有些行业，这种杀估值并未结束，就以地产行业举例：从 08 年以来，地产行业一直都保持着稳健增长，房价也持续增长，典型的量价提升。可是，根据公开数据显示，龙头的万科过去 13 年利润增长超过 7.5 倍，现在的股价只比 07 年高点涨了 37%。不仅仅是地产股，保险股也如此，龙头中国平安过去 13 年利润增长达到 8.5 倍，现在的股价只比 07 年高点涨了 8%。我们不能说这两个企业不优秀，他们一直保持超出行业的增长。估值并不完全



由成长性所决定的，更大的影响因素是产业趋势的预期。以我们过去的经验总结，只有拥抱代表未来趋势的新兴产业，伴随时代的发展才能确保投资过程中不被估值反噬，从而赚取利润增长的钱。

美国也是同样的演绎。过去 13 年的美股牛市是科技成长股的牛市，并且没有大小盘之分，中小盘成长比大盘成长表现毫不逊色，但是，传统的价值股却远远跑输于科技成长股。这是为什么？大家都知道经济增长的三大增长要素：劳动力、资本投入以及全要素生产率。在 08 年之后，美国在劳动力和资本投入上遇到长期瓶颈，长期经济增长的指望都体现在全要素生产率。因此，代表着劳动力与资本投入的传统经济股从此熄火，代表着全要素生产率的各种科技股进入轰轰烈烈的大牛市。过去十几年的美股是这样，随着传统经济增长模式日趋乏力，A 股的未来大概率也会这样演绎。

由于市场抱团大盘成长，这些股票出现了明显的溢价，甚至严重透支了长期成长空间。因此，我们认为市场的机会并不是来自 5% 的高估值抱团股，更多来自于剩余的 95% 的股票。但这并不是说，剩余的 95% 股票会有系统性机会，而是机会可能诞生于这些股票中。这也意味着未来赚钱难度大大增加，筛选难度大幅上升。

我们如何从中挖掘机会呢？首先，我们希望这些企业的行业处在时代的风口，新冠疫情全球蔓延、老龄化越来越严重和地缘政治越来越复杂，这意味着未来的十年不同于过往的十年，这都是我们选择行业的时候所必须要考虑的。其次，我们希望有较大的潜在行业空间和较大的潜在市值空间；最后，我们希望公司有出色的管理层和不断进化的管理能力。对这种公司的研究就依赖于我在去年三季报所谈论的企业生命力定价。我们希望在合理估值上洞察未来，希望投资符合产业趋势的具备强大生命力的企业。以上也部分解释了我们为何重点投资半导体与智能电动车领域。

经历多年的盐碱地检验，我们相信我们的方法论完全有能力应对更难更复杂的股票筛选的挑战。

#### 关于基金的区分

我们现在管理的优选、环保优势、创新成长和成长领航等四个基金是基于去年三季报所描述的企业生命力评估的方法论策略。我们这四个基金会大量投资在企业成长的早中期，市值从 30 亿至万亿不等，市值横跨面很广，体现明显的多层次投资。

景顺长城成长龙头也是全行业基金，但是会更聚焦于大市值龙头成长股。

景顺长城公司治理基金操作思路更偏向于争取绝对收益，但有较多仓位投资于中小市值股票。

景顺长城电子信息产业与新能源产业则专注于科技股和新能源产业投资的行业基金，也是我们团队管理的基金。由于专注科技股投资和新能源产业，该基金会体现更高的波动率，我们希望

通过产业切入的方式实现较好的选股 alpha。

#### 结束语

尽管在上半年，市场快速反弹，出现明显的赚钱效应。但是，面对百年不遇的变局，资本市场势必动荡加大，未来的波动依旧不会小，面对未来的风浪，我们努力把稳船舵，破浪前行。我们希望在波动的过程中，投资者依然能保持对我们的信任，我们定当努力不辜负信任。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城环保优势股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	682,957,679.38	543,184,749.09
结算备付金		3,163,520.94	4,279,629.61
存出保证金		737,196.82	828,640.57
交易性金融资产	6.4.7.2	5,979,860,531.49	5,606,324,072.31
其中：股票投资		5,965,198,731.49	5,606,324,072.31
基金投资		-	-
债券投资		14,661,800.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	209,475,634.22
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	65,707.98	91,881.50

应收股利		-	-
应收申购款		24,938,061.30	12,661,947.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,691,722,697.91	6,376,846,554.91
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		54,606,054.45	48,637,328.18
应付赎回款		65,608,379.37	25,789,082.98
应付管理人报酬		7,256,877.34	7,087,735.11
应付托管费		1,209,479.54	1,181,289.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,044,571.33	3,190,719.48
应交税费		64.48	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	261,878.76	415,050.33
负债合计		131,987,305.27	86,301,205.26
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,721,659,584.41	1,873,581,012.93
未分配利润	6.4.7.10	4,838,075,808.23	4,416,964,336.72
所有者权益合计		6,559,735,392.64	6,290,545,349.65
负债和所有者权益总计		6,691,722,697.91	6,376,846,554.91

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 3.810 元，基金份额总额 1,721,659,584.41 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城环保优势股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		782,023,716.85	847,170,918.60
1. 利息收入		992,159.44	1,870,610.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	931,075.21	1,755,348.61

债券利息收入		13,256.82	3,130.72
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		47,827.41	112,130.74
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		473,492,303.85	548,296,863.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	450,935,805.98	510,968,701.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,789,503.46	8,067,277.88
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	20,766,994.41	29,260,883.55
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	300,164,160.76	288,751,404.35
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,375,092.80	8,252,041.01
减：二、费用		57,918,363.79	41,396,164.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	41,480,457.68	27,844,871.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,913,409.58	4,640,811.89
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	9,365,121.58	8,771,662.33
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		47.71	11.26
7. 其他费用	6.4.7.19	159,327.24	138,807.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		724,105,353.06	805,774,754.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		724,105,353.06	805,774,754.03

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城环保优势股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,873,581,012.93	4,416,964,336.72	6,290,545,349.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	724,105,353.06	724,105,353.06
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)	-151,921,428.52	-302,993,881.55	-454,915,310.07
其中：1. 基金申购款	847,898,307.32	1,979,650,422.81	2,827,548,730.13
2. 基金赎回款	-999,819,735.84	-2,282,644,304.36	-3,282,464,040.20
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,721,659,584.41	4,838,075,808.23	6,559,735,392.64
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,069,940,523.54	1,038,122,278.58	2,108,062,802.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	805,774,754.03	805,774,754.03
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)	768,284,308.66	898,739,860.50	1,667,024,169.16
其中：1. 基金申购款	1,882,603,380.73	2,283,528,505.30	4,166,131,886.03
2. 基金赎回款	-1,114,319,072.07	-1,384,788,644.80	-2,499,107,716.87
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)	-	-	-

号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,838,224,832.20	2,742,636,893.11	4,580,861,725.31

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

景顺长城环保优势股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1622 号文《关于准予景顺长城环保优势股票型证券投资基金注册的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城环保优势股票型证券投资基金基金合同》作为发起人于 2016 年 1 月 12 日至 2016 年 3 月 11 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2016)验字第 60467014\_H02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 3 月 15 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 256,455,323.47 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 131,541.79 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 256,586,865.26 元，折合 256,586,865.26 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，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金投资范围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（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金将基金资产的 80%-95% 投资于股票资产，投资于具有环保优势的上市公司发行的股票占非现金资产的比例不低于 80%。权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，将基金资产的 5%-20% 投资于现金和债券等固定收益类品种，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算

备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证环保产业指数收益率×40%+沪深 300 指数收益率×40%+中证全债指数收益率×20%。

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税及附加、企业所得税

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服



务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

### (3) 个人所得税

个人所得税税率为20%。

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

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	682,957,679.38
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月至 1 年	-
存款期限 1 年以上	-
其他存款	-
合计	682,957,679.38

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,390,016,712.88	5,965,198,731.49	1,575,182,018.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	14,661,800.00	14,661,800.00
	银行间市场	-	-
	合计	14,661,800.00	14,661,800.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,404,678,512.88	5,979,860,531.49	1,575,182,018.61

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于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

本基金于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

本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	62,150.36
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	1,281.24
应收债券利息	1,977.85
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	298.53
合计	65,707.98

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末的其他资产余额为零。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,044,571.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,044,571.33

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	133,864.02
应付证券出借违约金	-
预提费用	128,014.74
合计	261,878.76

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,873,581,012.93	1,873,581,012.93
本期申购	847,898,307.32	847,898,307.32
本期赎回（以“-”号填列）	-999,819,735.84	-999,819,735.84
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,721,659,584.41	1,721,659,584.41

注：本报告期申购份额包含基金转入份额；本报告期赎回份额包含基金转出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,410,953,337.13	2,006,010,999.59	4,416,964,336.72
本期利润	423,941,192.30	300,164,160.76	724,105,353.06
本期基金份额交易产生的变动数	-199,775,320.33	-103,218,561.22	-302,993,881.55
其中：基金申购款	1,165,333,374.61	814,317,048.20	1,979,650,422.81
基金赎回款	-1,365,108,694.94	-917,535,609.42	-2,282,644,304.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,635,119,209.10	2,202,956,599.13	4,838,075,808.23

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	889,987.78
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	34,787.87
其他	6,299.56
合计	931,075.21

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	3,230,759,912.53
减：卖出股票成本总额	2,779,824,106.55
买卖股票差价收入	450,935,805.98

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	28,593,480.08
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	26,792,300.00
减：应收利息总额	11,676.62
买卖债券差价收入	1,789,503.46

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金于本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	20,766,994.41
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	20,766,994.41

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	300,164,160.76
股票投资	300,164,160.76
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	300,164,160.76

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	6,958,590.40
基金转换费收入	416,502.40
合计	7,375,092.80

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	9,365,121.58
银行间市场交易费用	-
合计	9,365,121.58

### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	59,507.37
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	21,352.50
其他	360.00
合计	159,327.24

### 6.4.7.20 分部报告

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

## 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，本基金无需作披露的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

## 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、注册登记机构、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”）	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

	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	219,732,936.46	3.68	22,902,553.38	0.37

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均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 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	204,638.29	3.68	204,638.29	6.72
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	21,329.40	0.37	21,329.40	1.09

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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	41,480,457.68	27,844,871.37
其中：支付销售机构的客户维护费	9,409,479.03	7,267,535.70

注：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

**6.4.10.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,913,409.58	4,640,811.89

注：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

**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**

本基金于本报告期及上年度可比期间均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于本报告期及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**

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元



关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	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	682,957,679.38	889,987.78	426,191,930.08	1,700,700.41

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，并按银行间同业利率计息。

#### 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在承销期内均未参与关联方承销的证券投资。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002507	涪陵榨菜	2021年5月17日	2021年11月18日	非公开发行	33.58	35.69	744,491	25,000,007.78	26,570,883.79	-
002841	视源股份	2021年5月20日	2021年11月22日	大宗交易流通受限	119.28	117.88	130,000	15,506,400.00	15,324,400.00	-
300001	特锐德	2021年4月28日	2021年11月8日	非公开发行	23.18	27.78	345,125	7,999,997.50	9,587,572.50	-
300562	乐心医疗	2021年3月8日	2021年9月13日	非公开发行	16.48	14.35	728,155	11,999,994.40	10,449,024.25	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-

300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股流通受限	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021年6月4日	2021年8月25日	新股流通受限	-	27.42	108	-	2,961.36	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利	2021年4月	2021年10月	新股流	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-

	集团	月 15 日	月 26 日	通受限						
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-

605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688007	光峰科技	2021年4月27日	2021年10月27日	大宗交易流通受限	22.85	39.10	1,000,000.00	22,850,000.00	39,100,000.00	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688092	爱科科技	2021年3月12日	2021年9月22日	新股流通受限	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
688217	睿昂基因	2021年5月7日	2021年11月17日	新股流通受限	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688276	百克生物	2021年6月17日	2021年12月27日	新股流通受限	36.35	79.48	3,486	126,716.10	277,067.28	-
688314	康拓医疗	2021年5月11日	2021年11月18日	新股流通受限	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
688328	深科达	2021年3月1日	2021年9月9日	新股流通受限	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-
688396	华润微	2021年4月28日	2021年10月26日	非公开发行	48.00	83.97	729,167	35,000,016.00	61,228,152.99	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688517	金冠电气	2021年6月10日	2021年12月20日	新股流通受限	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
688611	杭州柯林	2021年4月1日	2021年10月12日	新股流通受限	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00	-
688616	西力科技	2021年3月10日	2021年9月22日	新股流通受限	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04	-
688665	四方光电	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127037	银轮转债	2021年6月7日	2021年7月9日	新债未上市	100.00	100.00	95,534	9,553,400.00	9,553,400.00	-
127038	国微转债	2021年6月10日	2021年7月14日	新债未上市	100.00	100.00	51,084	5,108,400.00	5,108,400.00	-

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

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	8,627,219	221,424,697.46	486,143,790.65	-

**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**

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

**6.4.13 金融工具风险及管理****6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

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

**6.4.13.2 信用风险**

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对

手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

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

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.22%（上年末：0.0%）。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的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。

本基金管理人通过定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	682,957,679.38	-	-	-	-	-	682,957,679.38
结算备付金	3,163,520.94	-	-	-	-	-	3,163,520.94

存出保证金	737,196.82	-	-	-	-	-	737,196.82
交易性金融资产	-	-	-	-	14,661,800.00	5,965,198,731.49	5,979,860,531.49
应收利息	-	-	-	-	-	65,707.98	65,707.98
应收申购款	-	-	-	-	-	24,938,061.30	24,938,061.30
资产总计	686,858,397.14	-	-	-	14,661,800.00	5,990,202,500.77	6,691,722,697.91
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	65,608,379.37	65,608,379.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,256,877.34	7,256,877.34
应付托管费	-	-	-	-	-	1,209,479.54	1,209,479.54
应付证券清算款	-	-	-	-	-	54,606,054.45	54,606,054.45
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,044,571.33	3,044,571.33
应交税费	-	-	-	-	-	64.48	64.48
其他负债	-	-	-	-	-	261,878.76	261,878.76
负债总计	-	-	-	-	-	131,987,305.27	131,987,305.27
利率敏感度缺口	686,858,397.14	-	-	-	14,661,800.00	-	-
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	543,184,749.09	-	-	-	-	-	543,184,749.09
结算备付金	4,279,629.61	-	-	-	-	-	4,279,629.61
存出保证金	828,640.57	-	-	-	-	-	828,640.57
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,606,324,072.31	5,606,324,072.31
买入返售金融资产	209,475,634.22	-	-	-	-	-	209,475,634.22
应收利息	-	-	-	-	-	91,881.50	91,881.50
应收申购款	-	-	-	-	-	12,661,947.61	12,661,947.61
资产总计	757,768,653.49	-	-	-	-	5,619,077,901.42	6,376,846,554.91
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	25,789,082.98	25,789,082.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,087,735.11	7,087,735.11
应付托管费	-	-	-	-	-	1,181,289.18	1,181,289.18
应付证券清算款	-	-	-	-	-	48,637,328.18	48,637,328.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,190,719.48	3,190,719.48
其他负债	-	-	-	-	-	415,050.33	415,050.33
负债总计	-	-	-	-	-	86,301,205.26	86,301,205.26
利率敏感度缺口	757,768,653.49	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.22%（上年末：0.0%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。



#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,965,198,731.49	90.94	5,606,324,072.31	89.12
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	5,965,198,731.49	90.94	5,606,324,072.31	89.12

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）	
分析	沪深 300 指数上升 5%	267,774,363.16	327,366,971.70
	沪深 300 指数下降 5%	-267,774,363.16	-327,366,971.70

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 2. 其他事项

###### (1) 公允价值

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

###### 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 5,314,785,264.68 元，划分为第二层次的余额为人民币 665,075,266.81 元，无划分为第三层次的余额（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 5,543,417,372.23 元，划分为第二层次的余额为人民币 62,906,700.08 元，无划分为第三层次的余额）。

###### 公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

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

###### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 3. 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 8 月 19 日经本基金的基金管理人批准。

## §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	5,965,198,731.49	89.14
	其中：股票	5,965,198,731.49	89.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,661,800.00	0.22
	其中：债券	14,661,800.00	0.22
	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	686,121,200.32	10.25
8	其他各项资产	25,740,966.10	0.38
9	合计	6,691,722,697.91	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	5,850.78	0.00
B	采矿业	41,185,710.00	0.63
C	制造业	5,079,320,905.03	77.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	37,455.46	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	327,485,616.20	4.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	280,609,092.89	4.28
J	金融业	124,370,882.30	1.90
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	112,144,827.07	1.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,965,198,731.49	90.94

### 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	8,627,219	486,143,790.65	7.41
2	300207	欣旺达	12,322,595	401,223,693.20	6.12
3	002352	顺丰控股	4,837,306	327,485,616.20	4.99
4	002049	紫光国微	2,066,584	318,646,586.96	4.86
5	300037	新宙邦	3,019,669	302,268,866.90	4.61
6	300568	星源材质	6,956,379	287,785,399.23	4.39
7	688116	天奈科技	2,404,658	283,749,644.00	4.33
8	688099	晶晨股份	2,500,595	280,566,759.00	4.28
9	002841	视源股份	2,214,026	274,347,991.54	4.18
10	000625	长安汽车	8,898,823	233,861,068.44	3.57
11	300001	特锐德	6,638,180	199,071,458.55	3.03
12	300482	万孚生物	3,015,194	195,052,899.86	2.97
13	603601	再升科技	15,037,367	173,982,336.19	2.65
14	688299	长阳科技	6,354,626	171,447,809.48	2.61
15	603515	欧普照明	6,375,875	163,668,711.25	2.50
16	688002	睿创微纳	1,549,070	154,643,658.10	2.36
17	002409	雅克科技	1,840,124	149,050,044.00	2.27
18	300790	宇瞳光学	3,970,418	134,716,282.74	2.05
19	688019	安集科技	411,375	127,937,625.00	1.95
20	601318	中国平安	1,934,290	124,336,161.20	1.90
21	002126	银轮股份	11,920,514	123,973,345.60	1.89
22	603197	保隆科技	3,465,658	113,985,491.62	1.74
23	601827	三峰环境	10,558,942	99,993,180.74	1.52
24	002906	华阳集团	2,621,293	82,780,432.94	1.26
25	300630	普利制药	1,555,754	81,521,509.60	1.24
26	603788	宁波高发	4,868,939	61,543,388.96	0.94
27	688396	华润微	729,167	61,228,152.99	0.93
28	002507	涪陵榨菜	1,663,425	61,177,938.23	0.93
29	603920	世运电路	3,885,807	54,517,872.21	0.83
30	688169	石头科技	41,036	51,746,396.00	0.79

31	300829	金丹科技	670,207	43,898,558.50	0.67
32	002475	立讯精密	952,560	43,817,760.00	0.67
33	000762	西藏矿业	1,549,500	41,185,710.00	0.63
34	600745	闻泰科技	408,576	39,591,014.40	0.60
35	688598	金博股份	145,400	39,112,600.00	0.60
36	688007	光峰科技	1,000,000	39,100,000.00	0.60
37	688398	赛特新材	921,739	37,551,646.86	0.57
38	600893	航发动力	560,000	29,786,400.00	0.45
39	603160	汇顶科技	133,151	17,260,364.13	0.26
40	300888	稳健医疗	120,220	14,861,596.40	0.23
41	000888	峨眉山 A	1,888,800	12,107,208.00	0.18
42	600418	江淮汽车	959,400	11,925,342.00	0.18
43	300562	乐心医疗	728,155	10,449,024.25	0.16
44	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.00
45	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.00
46	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
47	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
48	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
49	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
50	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.00
51	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
52	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.00
53	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.00
54	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.00
55	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
56	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
57	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.00
58	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
59	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.00
60	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
61	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.00
62	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
63	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
64	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
65	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
66	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
67	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
68	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
69	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
70	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
71	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
72	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00

73	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
74	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
75	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
76	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
77	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
78	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
79	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
80	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
81	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
82	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
83	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
84	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
85	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
86	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
87	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
88	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
89	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
90	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
91	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
92	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
93	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
94	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
95	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
96	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
97	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
98	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
99	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
100	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
101	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
102	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
103	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
104	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
105	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
106	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
107	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
108	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
109	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	600460	士兰微	221,424,697.46	3.52
2	300207	欣旺达	160,896,752.99	2.56
3	688002	睿创微纳	148,513,903.81	2.36
4	002409	雅克科技	135,321,378.65	2.15
5	300790	宇瞳光学	122,738,423.34	1.95
6	603160	汇顶科技	122,067,777.64	1.94
7	688019	安集科技	107,326,455.80	1.71
8	002352	顺丰控股	107,202,051.10	1.70
9	601827	三峰环境	95,909,521.17	1.52
10	000066	中国长城	92,046,773.20	1.46
11	300001	特锐德	85,152,344.56	1.35
12	300630	普利制药	81,757,075.64	1.30
13	688299	长阳科技	74,518,811.63	1.18
14	002906	华阳集团	73,245,471.32	1.16
15	688396	华润微	71,652,966.98	1.14
16	300037	新宙邦	71,036,379.40	1.13
17	002126	银轮股份	65,949,502.36	1.05
18	002841	视源股份	64,447,709.90	1.02
19	300482	万孚生物	62,347,929.01	0.99
20	000625	长安汽车	58,143,806.00	0.92

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	688169	石头科技	360,646,120.70	5.73
2	600893	航发动力	207,838,681.42	3.30
3	300568	星源材质	156,713,087.35	2.49
4	002507	涪陵榨菜	142,414,489.23	2.26
5	300073	当升科技	137,543,979.62	2.19
6	002056	横店东磁	134,086,589.69	2.13
7	603160	汇顶科技	120,888,151.29	1.92
8	300888	稳健医疗	114,913,881.86	1.83
9	300776	帝尔激光	113,893,939.30	1.81
10	002841	视源股份	109,123,016.96	1.73
11	300207	欣旺达	107,315,276.29	1.71
12	300010	豆神教育	98,218,129.98	1.56
13	000066	中国长城	91,165,218.84	1.45
14	300378	鼎捷软件	90,894,257.44	1.44
15	300616	尚品宅配	87,875,696.14	1.40

16	000625	长安汽车	80,724,664.75	1.28
17	688018	乐鑫科技	76,868,451.03	1.22
18	688099	晶晨股份	74,191,702.96	1.18
19	300766	每日互动	58,074,554.72	0.92
20	603515	欧普照明	53,396,110.71	0.85

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	2,838,534,604.97
卖出股票收入（成交）总额	3,230,759,912.53

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	14,661,800.00	0.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,661,800.00	0.22

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127037	银轮转债	95,534	9,553,400.00	0.15
2	127038	国微转债	51,084	5,108,400.00	0.08

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。



## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

1、时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

2、套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

3、合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	737,196.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	65,707.98
5	应收申购款	24,938,061.30

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,740,966.10

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600460	士兰微	486,143,790.65	7.41	重大事项停牌
2	002841	视源股份	15,324,400.00	0.23	大宗交易流通受限

#### 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 (%)
429,666	4,006.97	1,035,039,838.52	60.12	686,619,745.89	39.88

### 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	1,874,627.81	0.108885

### 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	0~10
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 (2016 年 3 月 15 日) 基金份额总额	256,586,865.26
-------------------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	1,873,581,012.93
本报告期基金总申购份额	847,898,307.32
减：本报告期基金总赎回份额	999,819,735.84
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,721,659,584.41

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

本基金管理人于 2021 年 3 月 30 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任刘彦春先生担任本公司副总经理。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

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

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券股份有限公司	2	1,173,143,364.11	19.62%	1,092,551.68	19.62%	-
西部证券股份有限公司	2	1,033,877,704.90	17.29%	962,852.01	17.29%	-
广发证券股份有限公司	1	472,620,011.48	7.91%	440,157.79	7.91%	-
中信建投证券股份有限公司	2	361,297,256.01	6.04%	336,476.58	6.04%	-
中泰证券股份有限公司	2	337,216,669.65	5.64%	314,052.69	5.64%	-
中银国际证券股份有限公司	1	322,770,412.17	5.40%	300,597.01	5.40%	-
东北证券股份有限公司	1	294,923,997.80	4.93%	274,661.74	4.93%	-
国信证券股份有限公司	2	257,598,429.61	4.31%	240,463.21	4.32%	-
长江证券股份有限公司	1	225,318,154.27	3.77%	209,838.84	3.77%	-
长城证券股份有限公司	2	219,732,936.46	3.68%	204,638.29	3.68%	-
天风证券股份有限公司	1	210,946,980.33	3.53%	196,455.15	3.53%	-
汇丰前海证券有限责任公司	1	189,939,787.08	3.18%	176,891.59	3.18%	-
方正证券股份有限公司	1	184,266,621.10	3.08%	171,607.11	3.08%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	165,701,453.13	2.77%	154,317.24	2.77%	-
东方财富证券股份有限公司	2	159,877,526.77	2.67%	148,894.28	2.67%	-
东方证券股份有限公司	1	120,387,726.56	2.01%	112,117.56	2.01%	-
渤海证券股份有限公司	1	115,166,577.61	1.93%	107,253.01	1.93%	本期退租1个
中国国际金融股份	1	93,882,576.70	1.57%	87,433.08	1.57%	-

有限公司						
华创证券有限责任公司	1	29,647,654.72	0.50%	27,610.13	0.50%	-
中信证券股份有限公司	3	9,844,176.88	0.16%	9,167.45	0.16%	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	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。

### 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
光大证券股份有限公司	13,416.00	0.05%	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	16,175,239.28	56.57%	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
中银国际证券股份有限公司						
东北证券股份有限公司	12,404,824.80	43.38%				
国信证券股份有限公司						
长江证券股份有限公司						
长城证券股份有限公司						
天风证券股份有限公司						
汇丰前海证券有限责任公司						
方正证券股份有限公司						
国泰君安证券股份有限公司						
东方财富证券股份有限公司						
东方证券股份有限公司						
渤海证券股份有限公司						
中国国际金融股份有限公司						
华创证券有限责任公司						
中信证券股份有限公司						
安信证券股份有限公司						
招商证券股份有限公司						

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-08
2	关于景顺长城环保优势股票型证券投资基金新增招商银行股份有限公司招商银行赢通平台为销售平台及参加申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-12

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系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
5	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
6	景顺长城环保优势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旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
8	关于旗下部分基金新增上海农村商业银行股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-26
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	2021-02-05
10	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
11	关于旗下部分基金新增国联证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-18
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-25
13	关于旗下部分基金新增东吴证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-01
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金投资乐心医疗(代码: 300562.SZ)非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-09
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加安信证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-15
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	2021-03-20

18	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
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	2021-03-26
20	景顺长城环保优势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
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
22	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-30
23	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
24	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-12
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-15
26	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-19
27	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-20
28	景顺长城环保优势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
29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
30	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-23
31	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金投资华润微（代码：688396.SH）非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-29
32	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金投资特锐德（代码：300001.SZ）非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-29
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	2021-05-12
34	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金投资涪陵榨菜（代码：002507.SZ）非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-18
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	2021-05-20
36	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



37	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-15
38	景顺长城环保优势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	2021-06-18
39	景顺长城环保优势股票型证券投资基金基金合同更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
40	景顺长城环保优势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
41	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

## §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

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

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2021 年 8 月 23 日