

# 景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金

## 金

### 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 24 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 2020 年 8 月 20 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 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	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42

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 .....	42
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 .....	42
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 .....	42
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 .....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.12 投资组合报告附注 .....	43
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
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 .....	44
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>44</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</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 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	景顺长城睿成混合	
场内简称	无	
基金主代码	004707	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 11 月 10 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	306,456,059.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	景顺长城睿成混合 A 类	景顺长城睿成混合 C 类
下属分级基金的交 易代码	004707	004719
报告期末下属分级 基金的份额总额	306,452,654.33 份	3,405.48 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>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，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析和充分论证的基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合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</p> <p>本基金股票投资主要遵循“自下而上”的个股投资策略，结合公司股票研究数据库（SRD）对企业进行价值分析，深入挖掘相关股票的投资价值。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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、股指期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、权证投资策略</p> <p>本基金根据权证估值量化模型评估权证的内在合理价值，利用权证</p>

	与标的股票之间可能存在的投资机会，谨慎运用杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等策略获取权证投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	郭明
	联系电话	0755-82370388	(010) 66105799
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755-22381339	(010) 66105798
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		丁益	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(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)	
	景顺长城睿成混合 A 类	景顺长城睿成混合 C 类
本期已实现收益	5,929,374.87	1,444.64
本期利润	10,200,187.92	1,036.06

加权平均基金份额本期利润	0.0672	0.0536
本期加权平均净值利润率	6.02%	4.86%
本期基金份额净值增长率	9.04%	8.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	52,721,149.95	553.38
期末可供分配基金份额利润	0.1720	0.1625
期末基金资产净值	359,173,804.28	3,958.86
期末基金份额净值	1.1720	1.1624
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	17.20%	16.24%

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

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 景顺长城睿成混合 A 类

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	5.87%	0.49%	3.34%	0.44%	2.53%	0.05%
过去三个月	9.71%	0.58%	6.14%	0.45%	3.57%	0.13%
过去六个月	9.04%	0.79%	2.46%	0.74%	6.58%	0.05%
过去一年	17.21%	0.78%	7.64%	0.60%	9.57%	0.18%
自基金合同生效起至今	17.20%	1.11%	10.85%	0.65%	6.35%	0.46%

#### 景顺长城睿成混合 C 类

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	5.85%	0.49%	3.34%	0.44%	2.51%	0.05%
过去三个月	9.63%	0.58%	6.14%	0.45%	3.49%	0.13%
过去六个月	8.76%	0.79%	2.46%	0.74%	6.30%	0.05%
过去一年	16.73%	0.78%	7.64%	0.60%	9.09%	0.18%
自基金合同生效起至今	16.24%	1.11%	10.85%	0.65%	5.39%	0.46%

### 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

景顺长城睿成混合A类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



景顺长城睿成混合C类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：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交



易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的建仓期为自 2017 年 11 月 10 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 2020 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 96 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、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 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 TMT150 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、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、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、景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金、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。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		
徐喻军	本基金的基金经理、量化及指数投资部总监助理	2017 年 12 月 5 日	2020 年 4 月 17 日	10	理学硕士，CFA。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员；自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理，现担任量化及指数投资部总监助理兼基金经理。
曾理	本基金的基金经理	2020 年 4 月 18 日	-	6	工学硕士。曾任职于腾讯计算机系统有限公司信息安全部产品策略岗位。2014 年 8 月加入本公司，历任量化及 ETF 投资部量化程序员、量化及指数投资部基金经理助理，自 2018 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理。

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”为根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”为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遵规守信情况的说明

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》、《证券投资基金销售管理办法》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、《景顺长城睿成灵活配置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，本基金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 18 次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，公司旗下指数基金因指数成份股调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间虽然存在交易所证券临近交易日同向交易和银行间债券 5 日内反向交易，但结合交易时机及市场交易价格波动分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。

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

2020 年 6 月工业增加值当月同比 4.8%，前值 4.4%，同比增速继续回升。6 月 PMI 指数 50.9。6 月 PPI 同比-3%，环比 0.4%；6 月 CPI 同比上涨 2.5%，前值 2.4%，环比-0.1%。6 月 M2 同比增速 11.1%，M1 同比增速 6.5%，社会融资规模存量同比增长 12.8%。6 月末外汇储备 3.1 万亿美元。从上半年来看，一季度，在我国遭受新冠疫情超预期的爆发、强力应对措施的意见及国外疫情超预期扩散的背景下，A 股市场出现先跌后涨再跌的走势。二季度，在国内疫情控制较好和充裕流动性情况下，A 股市场得到一定程度修复，出现结构性分化。在此期间，上证综指、沪深 300 和创业板指数收益率分别为-2.15%、1.64%和 35.6%。

本基金操作思路上，依然以基本面选股为主，坚持自下而上与自上而下相结合的选股思路，重点把握细分行业和个股的投资策略，重点关注估值合理、盈利能力强、成长潜力高的公司，力争获取长期投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2020 年上半年，景顺长城睿成混合 A 份额净值增长率为 9.04%，业绩比较基准收益率为 2.46%。

2020 年上半年，景顺长城睿成混合 C 份额净值增长率为 8.76%，业绩比较基准收益率为

2.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，基建投资将进一步发力，政府债的发行带动社会融资指标继续上行，在稳就业和保民生的政策推动下，相关财政政策将会继续发力。央行通过精准直达实体方式，创设新工具推动宽信用的实现，起到稳经济保就业的托底作用。全球范围来看，A 股估值具有相对吸引力。我们整体看好成长股在市场企稳后的表现。流动性仍然比较宽裕，基本面较好的价值股，也会有较好表现。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，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，景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、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。本报告期内，景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

#### 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

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金 2020 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：景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	131,884,091.72	6,112,500.60
结算备付金		151,843.34	158,185.63
存出保证金		36,699.40	3,233.94
交易性金融资产	6.4.7.2	127,037,953.03	58,488,971.41
其中：股票投资		107,027,953.03	58,476,971.41
基金投资		-	-
债券投资		20,010,000.00	12,000.00

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	130,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	228,142.86	1,289.22
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		389,338,730.35	64,764,180.80
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019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		29,924,789.59	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		107,536.32	31,992.72
应付托管费		17,922.74	5,332.09
应付销售服务费		4.58	8.96
应付交易费用	6.4.7.7	31,150.86	60,323.57
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,563.12	120,000.00
负债合计		30,160,967.21	217,657.34
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	306,456,059.81	60,049,907.43
未分配利润	6.4.7.10	52,721,703.33	4,496,616.03
所有者权益合计		359,177,763.14	64,546,523.46
负债和所有者权益总计		389,338,730.35	64,764,180.80

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 306,456,059.81 份，景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 1.1720 元，份额总额 306,452,654.33 份；景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额净值人民币 1.1624 元，份额总额 3,405.48 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 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
		2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
一、收入		11,131,240.69	23,793,125.46
1. 利息收入		355,570.63	25,712.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	239,562.08	25,705.53
债券利息收入		16,028.65	7.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		99,979.90	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,504,959.22	-3,958,374.13
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,770,893.13	-4,568,472.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,598.11	8,537.52
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	730,467.98	601,560.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,270,404.47	27,725,786.92
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	306.37	-
减：二、费用		930,016.71	477,935.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	490,245.54	225,584.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	81,707.58	37,597.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	32.18	64.39
4. 交易费用	6.4.7.18	278,023.29	117,678.60
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	80,008.12	97,011.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,201,223.98	23,315,189.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		10,201,223.98	23,315,189.61



号填列)			
------	--	--	--

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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)	60,049,907.43	4,496,616.03	64,546,523.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,201,223.98	10,201,223.98
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)	246,406,152.38	38,023,863.32	284,430,015.70
其中：1. 基金申购款	306,567,211.51	43,556,182.61	350,123,394.12
2. 基金赎回款	-60,161,059.13	-5,532,319.29	-65,693,378.42
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)	306,456,059.81	52,721,703.33	359,177,763.14
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	120,596,158.34	-27,533,245.60	93,062,912.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,315,189.61	23,315,189.61
三、本期基金份额	-60,003,367.38	4,217,289.42	-55,786,077.96

额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	13,091.76	-808.65	12,283.11
2. 基金赎回款	-60,016,459.14	4,218,098.07	-55,798,361.07
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）	60,592,790.96	-766.57	60,592,024.39

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：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金（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]2259 号文《关于准予景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》以及证监许可[2017]674 号文《关于准予景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》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《景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金基金合同》作为发起人于 2017 年 10 月 30 日至 2017 年 11 月 6 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（2017）验字第 60467014\_H08 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 2017 年 11 月 10 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 251,680,732.00 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 26,529.02 元，以上实收基金合计为人民币 251,707,261.02 元，折合 251,707,261.02 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《景顺长城睿成灵活配置混

合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金分为不同的类别。A 类基金份额类别为在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；C 类基金份额为在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

#### 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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和会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	71,884,091.72
定期存款	60,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	60,000,000.00
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	131,884,091.72

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	97,750,619.11	107,027,953.03	9,277,333.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	20,025,600.00	20,010,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	20,025,600.00	20,010,000.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	117,776,219.11	127,037,953.03	9,261,733.92

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	130,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	130,000,000.00	-

##### 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 2020年6月30日
应收活期存款利息	8,335.27
应收定期存款利息	3,583.33
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	61.47
应收债券利息	213,287.67
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	2,860.27
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	14.85
合计	228,142.86

#### 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
----	-----

	2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	31,150.86
银行间市场应付交易费用	-
合计	31,150.86

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	79,563.12
合计	79,563.12

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 景顺长城睿成混合 A 类

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	60,016,018.70	60,016,018.70
本期申购	306,540,925.82	306,540,925.82
本期赎回 (以“-”号填列)	-60,104,290.19	-60,104,290.19
-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	306,452,654.33	306,452,654.33

## 景顺长城睿成混合 C 类

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	33,888.73	33,888.73
本期申购	26,285.69	26,285.69
本期赎回 (以“-”号填列)	-56,768.94	-56,768.94
-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	3,405.48	3,405.48

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

景顺长城睿成混合 A 类			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,477,580.73	7,971,863.09	4,494,282.36
本期利润	5,929,374.87	4,270,813.05	10,200,187.92
本期基金份额交易产生的变动数	54,285,144.74	-16,258,465.07	38,026,679.67
其中：基金申购款	56,826,282.34	-13,273,148.28	43,553,134.06
基金赎回款	-2,541,137.60	-2,985,316.79	-5,526,454.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,736,938.88	-4,015,788.93	52,721,149.95
景顺长城睿成混合 C 类			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,131.07	4,464.74	2,333.67
本期利润	1,444.64	-408.58	1,036.06
本期基金份额交易产生的变动数	1,285.43	-4,101.78	-2,816.35
其中：基金申购款	3,987.34	-938.79	3,048.55
基金赎回款	-2,701.91	-3,162.99	-5,864.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	599.00	-45.62	553.38

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	234,263.60
定期存款利息收入	3,583.33
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,514.79
其他	200.36
合计	239,562.08

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	77,955,240.13
减：卖出股票成本总额	72,184,347.00
买卖股票差价收入	5,770,893.13

## 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交	15,600.00



总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	12,000.00
减：应收利息总额	1.89
买卖债券差价收入	3,598.11

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	730,467.98
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	730,467.98

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	4,270,404.47
股票投资	4,286,004.47
债券投资	-15,600.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,270,404.47

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	47.26
基金转换费收入	259.11
合计	306.37

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	278,023.29
银行间市场交易费用	-
合计	278,023.29

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	445.00
合计	80,008.12

#### 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、注册登记人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人

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

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期和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

本基金于本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	490,245.54	225,584.30
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：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 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	81,707.58	37,597.43

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 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城睿成混合 A 类	景顺长城睿成混合 C 类	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	24.83	24.83
合计	-	24.83	24.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城睿成混合 A 类	景顺长城睿成混合 C 类	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	3.87	3.87
合计	-	3.87	3.87

注：基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

## 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	71,884,091.72	234,263.60	4,889,490.04	25,545.04

注：本基金的活期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在承销期内均未重大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(2020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
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-

300846	首都 在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股流 通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688027	国盾 量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	新股流 通受限	36.18	36.18	2,452	88,713.36	88,713.36	-
688277	天智 航	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 7 日	新股流 通受限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688377	迪威 尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股流 通受限	16.42	16.42	5,652	92,805.84	92,805.84	-
688528	秦川 物联	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 1 日	新股流 通受限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688568	中科 星图	2020 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 8 日	新股流 通受限	16.21	16.21	8,127	131,738.67	131,738.67	注
688600	皖仪 科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股流 通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

注：该股票的限售期限为自上市公司首次公开发行并上市之日起 6 个月，“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终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

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

#### 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证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，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（上年末：0.02%）。

#### 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。

本基金管理人通过由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 2020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
<b>资产</b>							
银行存款	131,884,091.72	-	-	-	-	-	131,884,091.72
结算备付金	151,843.34	-	-	-	-	-	151,843.34
存出保证金	36,699.40	-	-	-	-	-	36,699.40
交易性金融资产	-	-	20,010,000.00	-	-	107,027,953.03	127,037,953.03
买入返售金融资产	130,000,000.00	-	-	-	-	-	130,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	228,142.86	228,142.86
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	262,072,634.46	-	20,010,000.00	-	-	107,256,095.89	389,338,730.35
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	107,536.32	107,536.32
应付托管费	-	-	-	-	-	17,922.74	17,922.74
应付证券清算款	-	-	-	-	-	29,924,789.59	29,924,789.59
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4.58	4.58
应付交易费用	-	-	-	-	-	31,150.86	31,150.86
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	79,563.12	79,563.12
负债总计	-	-	-	-	-	30,160,967.21	30,160,967.21
利率敏感度缺口	262,072,634.46	-	20,010,000.00	-	-	-	-
上年度末	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

2019 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	6,112,500.60	-	-	-	-	-	6,112,500.60
结算备付金	158,185.63	-	-	-	-	-	158,185.63
存出保证金	3,233.94	-	-	-	-	-	3,233.94
交易性金融资产	-	-	-	-	12,000.00	58,476,971.41	58,488,971.41
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,289.22	1,289.22
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,273,920.17	-	-	-	12,000.00	58,478,260.63	64,764,180.80
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	31,992.72	31,992.72
应付托管费	-	-	-	-	-	5,332.09	5,332.09
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8.96	8.96
应付交易费用	-	-	-	-	-	60,323.57	60,323.57
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	120,000.00	120,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	217,657.34	217,657.34
利率敏感度缺口	6,273,920.17	-	-	-	12,000.00	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-26,154.55	-
	市场利率下降 25 个基点	26,203.54	-

#### 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 2020年6月30日		上年度末 2019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	107,027,953.03	29.80	58,476,971.41	90.60
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	107,027,953.03	29.80	58,476,971.41	90.60

##### 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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）	
分析	沪深300指数上升5%	7,016,415.66	2,926,460.05
	沪深300指数下降5%	-7,016,415.66	-2,926,460.05

#### 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 2020 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 106,402,756.57 元，划分为第二层次的余额为人民币 20,635,196.46 元，无划分为第三层次的余额（于 2019 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 58,470,393.37 元，划分为第二层次的余额为人民币 18,578.04 元，无划分为第三层次的余额）。

#### 公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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

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

#### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

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

(2) 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 2020 年 8 月 20 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	107,027,953.03	27.49
	其中：股票	107,027,953.03	27.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,010,000.00	5.14

	其中：债券	20,010,000.00	5.14
	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	130,000,000.00	33.39
	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	132,035,935.06	33.91
8	其他各项资产	264,842.26	0.07
9	合计	389,338,730.35	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	63,582,755.96	17.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,597,781.32	0.44
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,023,466.99	4.74
J	金融业	19,480,081.76	5.42
K	房地产业	3,367,462.00	0.94
L	租赁和商务服务业	1,063,870.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	912,535.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	107,027,953.03	29.80

### 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	601012	隆基股份	173,300	7,058,509.00	1.97
2	600519	贵州茅台	4,100	5,997,808.00	1.67
3	601318	中国平安	52,500	3,748,500.00	1.04
4	600570	恒生电子	32,890	3,542,253.00	0.99
5	002594	比亚迪	47,000	3,374,600.00	0.94
6	600703	三安光电	133,600	3,340,000.00	0.93
7	600690	海尔智家	156,300	2,766,510.00	0.77
8	600887	伊利股份	88,504	2,755,129.52	0.77
9	600406	国电南瑞	135,400	2,741,850.00	0.76
10	600031	三一重工	144,500	2,710,820.00	0.75
11	600036	招商银行	79,200	2,670,624.00	0.74
12	000858	五粮液	14,500	2,481,240.00	0.69
13	601166	兴业银行	155,200	2,449,056.00	0.68
14	002475	立讯精密	46,866	2,406,569.10	0.67
15	300059	东方财富	116,442	2,352,128.40	0.65
16	600050	中国联通	470,500	2,277,220.00	0.63
17	603288	海天味业	17,680	2,199,392.00	0.61
18	300014	亿纬锂能	43,530	2,082,910.50	0.58
19	600588	用友网络	46,770	2,062,557.00	0.57
20	600637	东方明珠	212,827	2,053,780.55	0.57
21	603986	兆易创新	8,400	1,981,644.00	0.55
22	600183	生益科技	67,600	1,978,652.00	0.55
23	600030	中信证券	81,200	1,957,732.00	0.55
24	002415	海康威视	61,300	1,860,455.00	0.52
25	601877	正泰电器	66,684	1,757,123.40	0.49
26	000063	中兴通讯	43,300	1,737,629.00	0.48
27	300124	汇川技术	38,600	1,466,414.00	0.41
28	600438	通威股份	83,700	1,454,706.00	0.41
29	000333	美的集团	22,320	1,334,512.80	0.37
30	000100	TCL 科技	209,300	1,297,660.00	0.36
31	600048	保利地产	85,900	1,269,602.00	0.35
32	601211	国泰君安	72,000	1,242,720.00	0.35
33	601727	上海电气	231,600	1,167,264.00	0.32
34	601985	中国核电	283,500	1,159,515.00	0.32
35	600885	宏发股份	27,900	1,119,348.00	0.31
36	002027	分众传媒	191,000	1,063,870.00	0.30
37	600845	宝信软件	17,840	1,053,987.20	0.29
38	002230	科大讯飞	27,200	1,018,096.00	0.28
39	002129	中环股份	45,100	1,012,946.00	0.28
40	002555	三七互娱	20,700	968,760.00	0.27

41	601138	工业富联	60,400	915,060.00	0.25
42	600977	中国电影	69,500	912,535.00	0.25
43	002202	金风科技	86,900	866,393.00	0.24
44	600999	招商证券	38,400	842,880.00	0.23
45	000002	万科A	31,300	818,182.00	0.23
46	601601	中国太保	28,600	779,350.00	0.22
47	300136	信维通信	14,100	747,582.00	0.21
48	601688	华泰证券	36,000	676,800.00	0.19
49	601628	中国人寿	24,800	674,808.00	0.19
50	002142	宁波银行	25,600	672,512.00	0.19
51	600271	航天信息	38,700	628,488.00	0.17
52	000938	紫光股份	14,600	627,508.00	0.17
53	300207	欣旺达	31,100	587,790.00	0.16
54	600340	华夏幸福	24,700	564,642.00	0.16
55	002236	大华股份	28,400	545,564.00	0.15
56	600837	海通证券	40,800	513,264.00	0.14
57	601336	新华保险	11,512	509,751.36	0.14
58	603160	汇顶科技	2,200	490,380.00	0.14
59	002463	沪电股份	19,400	484,612.00	0.13
60	000425	徐工机械	73,400	433,794.00	0.12
61	600021	上海电力	57,500	425,500.00	0.12
62	000066	中国长城	32,000	422,400.00	0.12
63	603806	福斯特	8,460	422,238.60	0.12
64	002624	完美世界	7,100	409,244.00	0.11
65	601009	南京银行	53,200	389,956.00	0.11
66	000568	泸州老窖	3,100	282,472.00	0.08
67	300383	光环新网	10,000	260,700.00	0.07
68	601155	新城控股	7,900	246,796.00	0.07
69	001979	招商蛇口	14,600	240,024.00	0.07
70	600779	水井坊	3,300	205,986.00	0.06
71	002368	太极股份	4,100	179,129.00	0.05
72	002268	卫士通	8,100	172,854.00	0.05
73	600606	绿地控股	22,800	140,904.00	0.04
74	002558	巨人网络	8,000	139,200.00	0.04
75	688568	中科星图	8,127	131,738.67	0.04
76	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.03
77	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.03
78	688377	迪威尔	5,652	92,805.84	0.03
79	688027	国盾量子	2,452	88,713.36	0.02
80	000656	金科股份	10,700	87,312.00	0.02
81	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02
82	603087	甘李药业	688	69,006.40	0.02

83	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
84	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
85	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
86	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
87	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
88	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
89	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	601012	隆基股份	5,632,033.00	8.73
2	600519	贵州茅台	4,553,407.50	7.05
3	601318	中国平安	4,203,939.00	6.51
4	002415	海康威视	3,548,420.00	5.50
5	600703	三安光电	3,152,889.00	4.88
6	000063	中兴通讯	2,997,647.00	4.64
7	002594	比亚迪	2,890,517.00	4.48
8	000858	五粮液	2,850,594.00	4.42
9	600036	招商银行	2,754,928.98	4.27
10	601166	兴业银行	2,698,544.00	4.18
11	600887	伊利股份	2,655,620.52	4.11
12	002475	立讯精密	2,653,339.32	4.11
13	600690	海尔智家	2,621,665.00	4.06
14	300014	亿纬锂能	2,593,874.00	4.02
15	600031	三一重工	2,546,899.00	3.95
16	600406	国电南瑞	2,501,488.00	3.88
17	600570	恒生电子	2,467,943.00	3.82
18	600050	中国联通	2,456,303.00	3.81
19	300059	东方财富	2,241,456.05	3.47
20	600637	东方明珠	2,057,601.82	3.19
21	000100	TCL 科技	2,000,306.00	3.10
22	000333	美的集团	1,933,875.80	3.00
23	603986	兆易创新	1,906,531.00	2.95
24	600030	中信证券	1,863,683.00	2.89
25	300124	汇川技术	1,835,525.00	2.84
26	600183	生益科技	1,775,056.00	2.75
27	601877	正泰电器	1,774,409.32	2.75
28	002230	科大讯飞	1,727,893.00	2.68
29	300498	温氏股份	1,701,946.00	2.64
30	002027	分众传媒	1,690,170.00	2.62



31	603288	海天味业	1,600,839.00	2.48
32	002202	金风科技	1,540,161.00	2.39
33	600588	用友网络	1,514,134.81	2.35
34	000002	万科A	1,444,423.42	2.24
35	600438	通威股份	1,315,409.00	2.04
36	601985	中国核电	1,299,116.00	2.01
37	600048	保利地产	1,295,076.00	2.01

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 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	601318	中国平安	4,617,303.00	7.15
2	600036	招商银行	3,022,294.00	4.68
3	000858	五粮液	2,847,238.97	4.41
4	300498	温氏股份	2,743,128.20	4.25
5	601186	中国铁建	1,842,563.00	2.85
6	002415	海康威视	1,809,456.62	2.80
7	601997	贵阳银行	1,795,753.00	2.78
8	601998	中信银行	1,794,690.00	2.78
9	000333	美的集团	1,779,008.00	2.76
10	600276	恒瑞医药	1,667,029.69	2.58
11	000651	格力电器	1,519,382.00	2.35
12	601377	兴业证券	1,519,146.16	2.35
13	600346	恒力石化	1,336,159.01	2.07
14	600606	绿地控股	1,281,274.00	1.99
15	000876	新希望	1,137,996.00	1.76
16	601818	光大银行	1,093,847.00	1.69
17	601009	南京银行	1,020,786.00	1.58
18	000568	泸州老窖	1,009,092.50	1.56
19	002475	立讯精密	978,469.00	1.52
20	000157	中联重科	967,481.00	1.50

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	116,449,324.15
卖出股票收入（成交）总额	77,955,240.13

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	20,010,000.00	5.57
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,010,000.00	5.57

## 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	019627	20 国债 01	200,000	20,010,000.00	5.57

## 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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	36,699.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	228,142.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	264,842.26

### 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

份额级别	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（%）
景顺长城睿成混合 A 类	191	1,604,464.16	306,449,246.77	100.00	3,407.56	0.00
景顺长城睿成混合 C 类	15	227.032	-	-	3,405.48	100.00
合计	206	1,487,650.78	306,449,246.77	100.00	6,813.04	0.00

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	景顺长城睿成混合 A 类	1,743.84	0.00
	景顺长城睿成混合 C 类	194.70	5.72
	合计	1,938.54	0.00

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	份额级别	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	景顺长城睿成混合 A 类	0~10
	景顺长城睿成混合 C 类	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城睿成混合 A 类	0~10
	景顺长城睿成混合 C 类	-
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城睿成混合 A 类	景顺长城睿成混合 C 类
基金合同生效日 (2017 年 11 月 10 日) 基金份额总额	120,010,000.00	131,697,261.02
本报告期期初基金份 额总额	60,016,018.70	33,888.73
本报告期基金总申购 份额	306,540,925.82	26,285.69
减: 本报告期基金总 赎回份额	60,104,290.19	56,768.94
本报告期基金拆分变 动份额(份额减少以 “-”填列)	-	-
本报告期末基金份 额总额	306,452,654.33	3,405.48

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:

1、本基金管理人于 2020 年 1 月 22 日发布公告, 因丁益董事长退休, 由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。

2、本基金管理人于 2020 年 3 月 6 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, 聘任李黎女士担任本公司副总经理。

3、本基金管理人于 2020 年 5 月 28 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, 同意吴建军先生辞去本公司首席信息官一职, 聘任张明先生担任本公司首席信息官。

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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国国际金融股份有限公司	2	59,227,019.12	30.66%	55,156.78	30.66%	-
中信建投证券股份有限公司	1	49,485,800.62	25.62%	46,086.63	25.62%	-
兴业证券股份有限公司	1	32,388,967.57	16.77%	30,163.74	16.77%	-
华创证券有限责任公司	1	19,369,325.66	10.03%	18,038.63	10.03%	-
瑞银证券有限责任公司	1	16,389,057.21	8.48%	15,263.20	8.48%	-
天风证券股份有限公司	1	8,307,269.18	4.30%	7,736.97	4.30%	-

中信证券股 份有限公司	2	6,919,512.80	3.58%	6,444.17	3.58%	-
申万宏源证 券有限公司	1	404,654.46	0.21%	376.84	0.21%	-
太平洋证券 股份有限公 司	1	344,214.30	0.18%	320.58	0.18%	-
安信证券股 份有限公司	1	109,772.52	0.06%	102.26	0.06%	-
国金证券股 份有限公司	1	90,760.35	0.05%	84.52	0.05%	-
招商证券股 份有限公司	1	74,088.56	0.04%	69.00	0.04%	-
方正证券股 份有限公司	2	30,701.72	0.02%	28.59	0.02%	-
华西证券股 份有限公司	1	24,425.11	0.01%	22.75	0.01%	本期 新增
东方证券股 份有限公司	3	21,766.64	0.01%	20.27	0.01%	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	本期 新增

国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞信方正证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
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状况稳定；
- c、经营行为规范，最近两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
中国国际金融股份有限公司	8,019,600.00	40.02%	130,000,000.00	38.24%	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	70,000,000.00	20.59%	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	12,021,600.00	59.98%	140,000,000.00	41.18%	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

安信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华西证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东方证券 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	-	-	-	-	-	-
第一创业 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国海证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券 股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
民生证券股份有限公司						
平安证券股份有限公司						
瑞信方正证券有限责任公司						
申港证券股份有限公司						
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	关于景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金暂停接受壹佰万元以上申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年1月17日
2	景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020年1月21日
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年1月21日
4	景顺长城基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年1月22日
5	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年1月30日
6	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年1月31日
7	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年2月3日
8	关于景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金恢复接受壹佰万元以上申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年2月6日
9	景顺长城基金管理有限公司及全资子公司投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年2月6日
10	景顺长城基金管理有限公司关于基金	中国证监会指定报刊及	2020年3月6日

	行业高级管理人员变更公告	网站	
11	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	2020 年 3 月 19 日
12	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 20 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 30 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 7 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 18 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 20 日
17	景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金 2019 年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 20 日
18	景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 22 日
19	景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 22 日
20	景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 22 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 22 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统农业银行渠道暂停支付的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 29 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统农业银行渠道恢复支付的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 30 日
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	2020 年 5 月 15 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员（首席信息官）变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 28 日

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20200207-20200630	-	68,524,961.56	-	68,524,961.56	22.36
	2	20200207-20200630	-	88,872,200.49	-	88,872,200.49	29.00
	3	20200207-20200630	-	74,547,503.07	-	74,547,503.07	24.33
	4	20200101-20200206	60,005,000.00	-	60,005,000.00	-	-
	5	20200629-20200630	-	74,504,581.65	-	74,504,581.65	24.31
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

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

#### 1、大额申购风险

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

#### 2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

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

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

### 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睿成灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城睿成灵活配置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

2020年8月24日