

景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金
(原景顺长城景瑞睿利回报定期开放混
合型证券投资基金)
2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

自 2020 年 12 月 26 日起原景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金转型为景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金。原景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 12 月 25 日止，景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金本报告期自 2020 年 12 月 26 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料(转型后).....	8
2.5 其他相关资料(转型前).....	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标(转型后).....	9
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前).....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	10
3.2 基金净值表现（转型前）.....	12
3.3 其他指标.....	14
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型后）.....	14
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）.....	14
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
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.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	23
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	23
§5 托管人报告	23
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	23
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.....	23
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	24
§6 审计报告（转型后）	24
6.1 审计报告基本信息.....	24

6.2 审计报告的基本内容	24
§6 审计报告（转型前）	26
6.1 审计报告基本信息	26
6.2 审计报告的基本内容	26
§7 年度财务报表（转型后）	28
7.1 资产负债表	28
7.2 利润表	29
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	30
7.4 报表附注	30
§7 年度财务报表（转型前）	49
7.1 资产负债表	49
7.2 利润表	51
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	52
7.4 报表附注	53
§8 投资组合报告（转型后）	73
8.1 期末基金资产组合情况	73
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	74
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	74
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	76
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	76
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	76
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	76
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	76
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	76
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	77
8.12 投资组合报告附注	77
§8 投资组合报告（转型前）	78
8.1 期末基金资产组合情况	78
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	78
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	79
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	80
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	81
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	81
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	82
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	82
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	82
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	82
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
8.12 投资组合报告附注	82

§9 基金份额持有人信息（转型后）	84
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	84
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	84
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	84
§9 基金份额持有人信息（转型前）	84
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	84
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	84
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	85
§10 开放式基金份额变动（转型后）	85
§10 开放式基金份额变动（转型前）	85
§11 重大事件揭示	85
11.1 基金份额持有人大会决议	85
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	86
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	86
11.4 基金投资策略的改变	86
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	87
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	87
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)	87
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)	92
11.8 其他重大事件（转型后）	97
11.8 其他重大事件（转型前）	97
§12 影响投资者决策的其他重要信息	102
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	102
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	103
§13 备查文件目录	103
13.1 备查文件目录	103
13.2 存放地点	103
13.3 查阅方式	104

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城景瑞睿利回报混合
场内简称	无
基金主代码	005007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 26 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,004,271.48 份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合
场内简称	无
基金主代码	005007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 27 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,953,672.61 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金主要通过投资于固定收益品种，同时适当投资于具备良好盈利能力的上市公司所发行的股票，在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会，根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券类、货币类、权益类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略</p> <p>（1）债券类属资产配置</p> <p>基金管理人根据国债、金融债、企业（公司）债、分离交易可转债债券部分等品种与同期限国债或央票之间收益率利差的扩大和收窄的分析，主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，</p>

	<p>降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。</p> <p>(2) 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>(3) 资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的的证券的久期与收益率的影响。</p> <p>3、权益资产投资策略</p> <p>(1) 股票投资策略</p> <p>本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略，本基金将从定性及定量两个方面加以考察分析投资标的。</p> <p>(2) 权证投资策略</p> <p>本基金不直接购买权证等衍生品资产，但有可能持有所持股票所派发的权证或因投资分离交易可转债而产生的权证等。本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，结合权证的溢价率、隐含波动率等指标选择权证的卖出时机。</p>
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×85%+ 沪深 300 指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金主要通过投资于固定收益品种，同时适当投资于具备良好盈利能力的上市公司所发行的股票，在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会，根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券类、货币类、权益类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。</p> <p>2、期限配置策略</p> <p>为合理控制本基金开放期的流动性风险，并满足每次开放期的流动性需求，本基金在每个封闭期将适当的采取期限配置策略，即将基金资产所投资标的的平均剩余存续期限与基金封闭期限进行适当的匹配。</p> <p>3、固定收益类资产投资策略</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、权益资产投资策略</p>

	本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略，本基金将从定性及定量两个方面加以考察分析投资标的。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×85%+ 沪深 300 指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	秦一楠
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599
传真		0755-22381339	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		李进	周慕冰

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于 2021 年 2 月 9 日变更为谷澍。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料(转型后)

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

2.5 其他相关资料(转型前)

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 12 月 26 日（基金合同生效日）-2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	4,697.20
本期利润	207,358.27
加权平均基金份额本期利润	0.0064
本期加权平均净值利润率	0.56%
本期基金份额净值增长率	0.57%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末
期末可供分配利润	4,860,876.41
期末可供分配基金份额利润	0.1519
期末基金资产净值	36,865,147.89
期末基金份额净值	1.1518
3.1.3 累计期末指标	2020 年末
基金份额累计净值增长率	0.57%

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。

5、本基金基金合同生效日为 2020 年 12 月 26 日。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 1 月 1 日 -2020 年 12 月 25 日	2019 年	2018 年
本期已实现收益	5,135,600.78	11,729,168.04	833,049.88
本期利润	2,579,664.58	15,390,845.36	1,371,308.73
加权平均基金份额本期利润	0.0396	0.1142	0.0044
本期加权平均净值利润率	3.54%	10.98%	0.44%
本期基金份额净值增长率	4.01%	10.54%	0.86%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年 12 月 25 日	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	4,791,137.23	6,891,645.07	-1,035,362.82
期末可供分配基金份额利润	0.1454	0.0838	-0.0050

期末基金资产净值	37,744,809.84	90,559,512.71	205,444,722.24
期末基金份额净值	1.1453	1.1011	0.9961
3.1.3 累计期末指标	2020 年 12 月 25 日	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	14.53%	10.11%	-0.39%

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。

5、本基金于 2020 年 12 月 25 日（基金合同失效前日）失效。

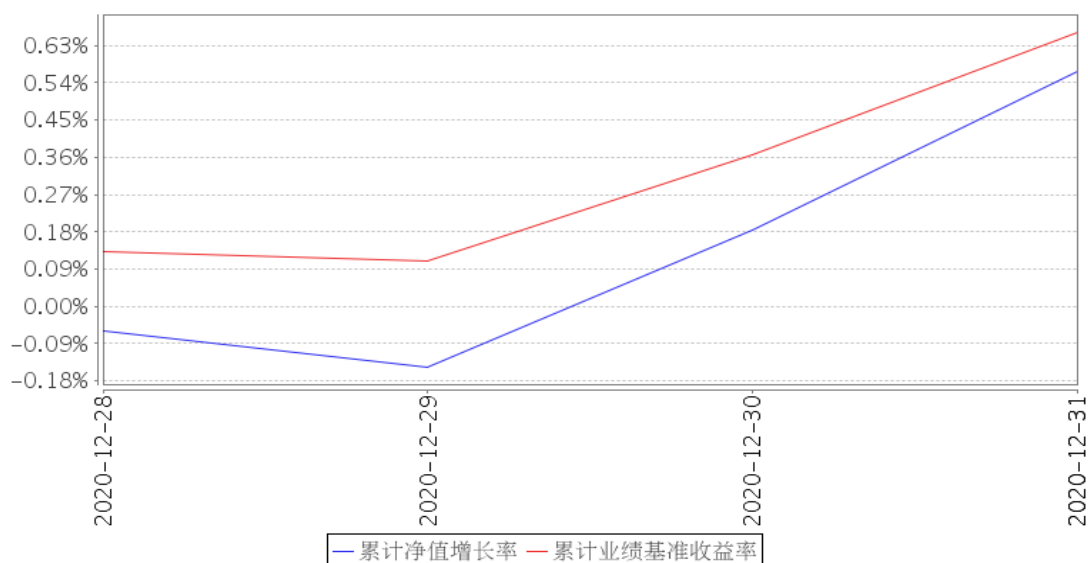
3.2 基金净值表现（转型后）

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
2020 年 12 月 26 日 （基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	0.57%	0.25%	0.66%	0.14%	-0.09%	0.11%

3.2.2 自基金转型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

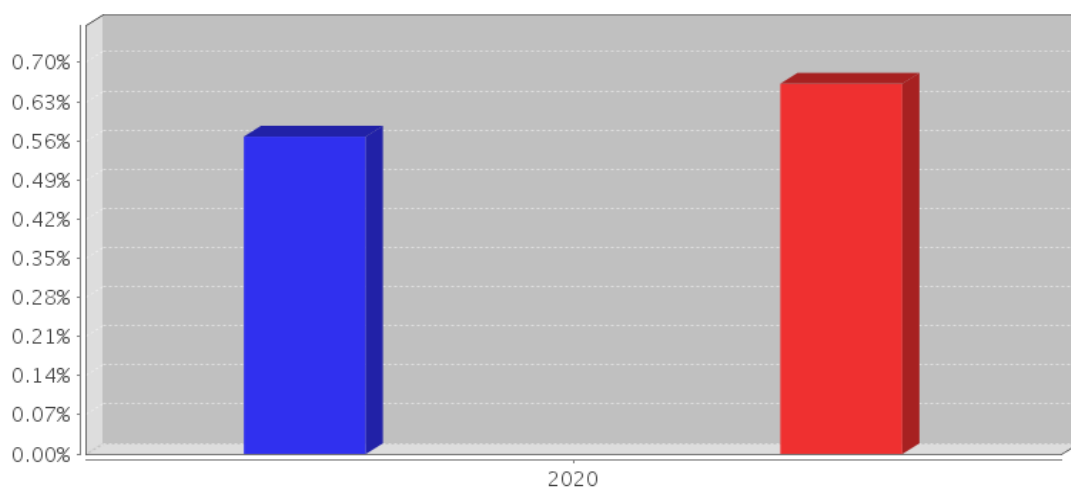
景顺长城景瑞睿利回报混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：因景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金（以下简称“景瑞睿利回报定期开放混合基金”）触发基金合同约定的转型条款，该基金自 2020 年 12 月 26 日转型为景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金（以下简称“景瑞睿利回报混合基金”）。因 2020 年 12 月 26 日非交易日，景瑞睿利回报混合型基金于 2020 年 12 月 28 日开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务。转型后的景瑞睿利回报混合基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 70%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。转型后，截至本报告期末，景瑞睿利回报混合基金仍处于建仓期。景瑞睿利回报混合基金合同生效日（2020 年 12 月 26 日）起至本报告期末不满一年。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城景瑞睿利回报混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



■ 景顺长城景瑞睿利回报混合净值增长率 ■ 景顺长城景瑞睿利回报混合业绩基准收益率

注：本基金转型后基金合同于2020年12月26日生效，因2020年12月26日非交易日，本基金于2020年12月28日开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务。2020年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是2020年12月28日至2020年12月31日。

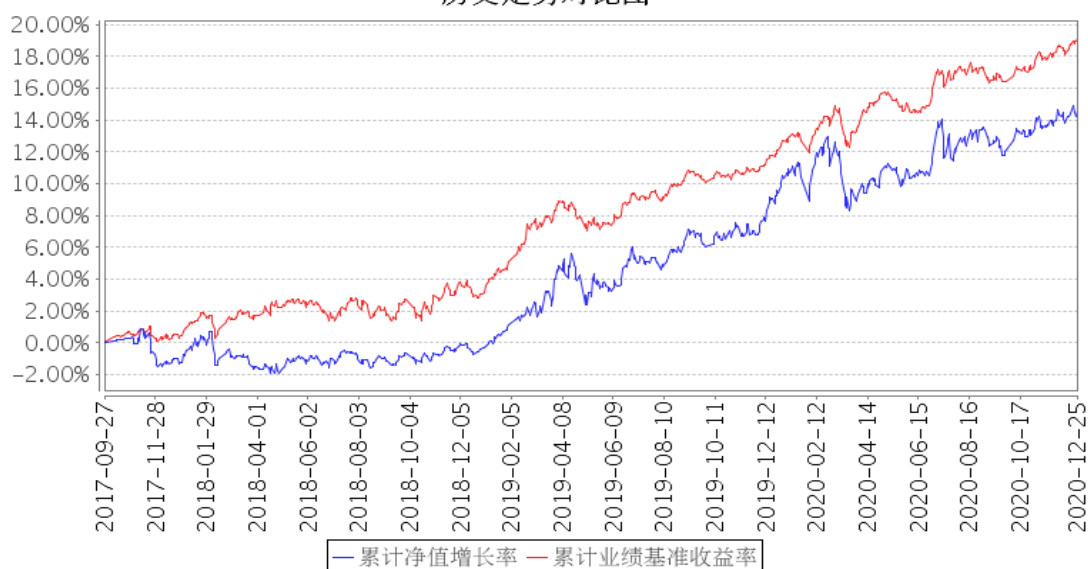
3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.16%	0.23%	2.34%	0.15%	-0.18%	0.08%
过去六个月	3.24%	0.31%	3.45%	0.20%	-0.21%	0.11%
过去一年	4.01%	0.33%	5.94%	0.20%	-1.93%	0.13%
过去三年	15.97%	0.28%	18.61%	0.20%	-2.64%	0.08%
基金合同生效日起至2020年12月25日（基金合同失效前日）	14.53%	0.27%	19.14%	0.19%	-4.61%	0.08%

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

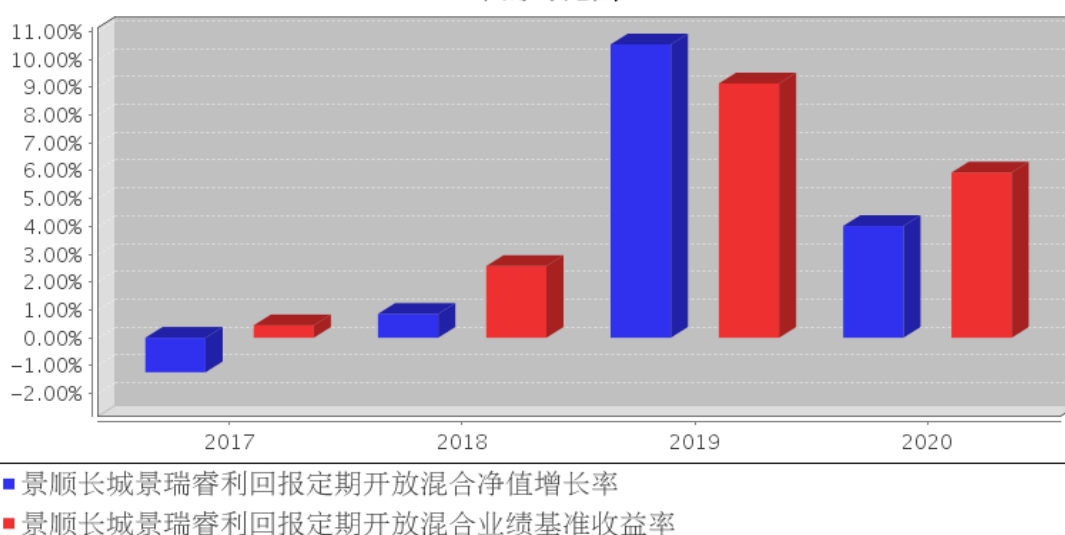
景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 70%（开放期开始前 10 个工作日至开放期结束后 10 个工作日内不受此比例限制），股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。任一开放期内，本基金持有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%，封闭期内不受前述 5% 的限制。本基金的建仓期为自 2017 年 9 月 27 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2017 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2017 年 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日。

2020 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 25 日（基金合同失效前日）。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

本基金自 2020 年 12 月 26 日（基金合同生效日）至本报告期末未进行利润分配。

3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

本基金自 2018 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 25 日（基金合同失效前日）未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会基金字[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 12 月 31 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 111 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、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、景顺长城中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、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。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（转型后）

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		
万梦	本基金的基金经理	2020 年 12 月 26 日	-	9 年	工学硕士。曾任职于壳牌（中国）有限公司。2011 年 9 月加入本公司，历任研究部行业研究员、固定收益部研究员和基金经理助理，自 2015 年 7 月起担任固定收益部基金经理。

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”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；

3、2020 年 12 月 26 日起“景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金”转型，同时变更名称为“景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金”。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
万梦	本基金的基金经理	2017年9月27日	2020年12月25日	9年	工学硕士。曾任职于壳牌（中国）有限公司。2011年9月加入本公司，历任研究部行业研究员、固定收益部研究员和基金经理助理，自2015年7月起担任固定收益部基金经理。

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”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；

3、2020年12月26日起“景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金”转型，同时变更名称为“景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金”。

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（转型后）

无。

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（转型前）

无。

4.1.4 基金经理薪酬机制（转型后）

暂无兼任情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制（转型前）

暂无兼任情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》、《景顺长城景瑞睿利回报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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理及绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解

释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易现象。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本期暂无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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 27 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

在新冠疫情影响下，2020 年全球资本市场度过了跌宕起伏的一年。2020 年全球经济开局良好，但在 1 月中下旬新冠疫情开始爆发，对中国及全球经济活动造成很大负面影响。春节以后，当中国疫情逐步受控后，3 月份包括欧美在内的海外国家疫情又出人意料的大爆发，全球资本市场陷入恐慌。新冠疫情导致经济活动急剧冻结，对全球经济冲击很大，其中中国一季度 GDP 同比增速为-6.8%，美国 GDP 二季度同比-9%，跌幅均创历史记录，而原油市场也在需求冲击和涉及交割的技术因素的影响下，4 月份甚至出现负油价结算。在此背景下，各国政府迅速出台了一系列刺激政策，以美国力度最大：美联储出台了包括无限量 QE 在内的一揽子综合刺激性政策，美国开启了包括直接向低收入人群发钱在内的刺激性财政政策。受此影响，全球股票市场迅速触底反弹，

全球经济也逐步走向修复。国内伴随着疫情受控，复工复产较为迅速，生产端快速恢复，工业生产逐月反弹，工业增加值增速从3月份-1.1%一路反弹到12月份的7.3%。而受益于海外疫情不能有效控制、生产恢复滞后于需求端的复苏，中国出口表现亮眼，四季度进一步加速，维持在双位数的高增长。而房地产投资保持着相当韧性，带动固定资产投资企稳回升。而受疫情的冲击，国内消费复苏相对缓慢，12月底社会消费品零售总额同比增长4.6%，增速尚未恢复到疫情前的水平。随着经济的逐步企稳复苏，央行货币政策逐步回归中性，从最为宽松的对冲疫情非常态模式回归常态，更加注重通过改革、规范、疏通等方式降低实体企业融资成本。

2020年全年债券市场较为震荡，走出V型走势：在新冠疫情冲击和宽松的流动性影响下，债券市场收益率先是一路下行，在4月末见全年收益率的低点，其中10年期国开收益率2.8%，比年初回落近80BP。随着央行货币政策逐步收敛转为中性，更多的引导资金进入实体经济，债券市场收益率触底反弹，持续向上，进入10月份以后债券市场收益率逐步企稳且小幅回落。但进入11月份，在永煤违约、机构大规模赎回债券基金连锁反应的冲击下，包括利率债和高等级信用债在内的债券品种被大幅抛售，收益率进一步上行，10年期国开债最高到3.79%，见年度高点。此后，央行货币政策在维稳需求下有所微调，资金面重回宽松，收益率逐步回落，年底10年期国开债收益率收于3.53%，自高点回落约26BP。从全年来看，1年期国开收益率收于2.56%，比年初反弹6BP，10年期国开收益率3.53%，比年初回落4BP，收益率曲线小幅走平。而信用利差出现走阔，中低等级信用债流动性大幅缺失。

权益方面，受疫情冲击，一季度A股大幅回落，上证综指下跌9.83%，而后逐季回升，全年上涨13.87%。而创业板指则全年大涨64.96%，创下近五年来新高。板块方面，结构性行情演绎非常极致，全年来看稳定消费和成长板块表现最好，其中食品饮料、新能源汽车、光伏等行业和板块表现最佳，全年涨幅超过80%，而经济相关性较高的周期品种表现落后。从行业PB估值来看，行业PB历史分位数的离散程度已至过去15年的高位。

本年度组合债券部分始终以中高等级信用债的配置为主，根据对市场的判断和开放期预计申赎情况灵活调整久期和杠杆。权益部分，以中期景气度较为确定的成长品种为主，如消费龙头、新能源汽车产业链和部分成长性较好的医药为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2020年12月26日(基金合同生效日)至本报告期末，本基金转型后份额净值增长率为0.57%，业绩比较基准收益率为0.66%；

2020年1月1日至12月25日(基金合同失效前日)，本基金转型前份额净值增长率为4.01%，业绩比较基准收益率为5.94%。

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 2021 年，全年 GDP 有望实现 9%左右的增长，综合 20-21 两年的增长来看，处于潜在增速水平附近，受基数影响 2021 年各季度 GDP 增速大体呈现出前高后低的走势，对上半年的经济高速增长已成市场共识，而下半年的经济增长情况目前仍有不少不确定性，争议焦点在于出口以及制造业投资高景气度的可持续性、基建房地产投资回落幅度，前者的节奏取决于海外疫情的演化，后者取决于国内的政策导向。我们判断目前宏观场景判断仍是“稳货币、紧信用”，信用周期逐步收敛符合预期，且由于本轮信用扩张的重要来源是财政扩张，相应的信用周期的收敛并不主要依赖于货币政策的收紧，我们相信“不急转弯”仍是当前货币政策的大基调，但考虑到经济的稳步复苏和部分结构性泡沫问题，维稳环境下流动性最宽松的阶段可能也已经过去。

债券方面，在 2021 年“稳货币、紧信用”的大环境下，信用风险事件将对市场形成冲击，无风险利率和高等级信用优于低等级信用，此时组合不会过多做信用下沉，而是多利用久期和杠杆策略来增厚收益。

权益市场方面，居民资产向股市迁移趋势仍在延续，预计市场短期能保持一定惯性，但考虑货币信用环境结合当前市场估值，部分高估值板块的波动可能会加大，我们需要提升组合防御性，更注重结构的选择，降低整体收益预期。从中期兼顾双循环背景来看，我们相对更看好代表消费升级、产业升级的优质龙头。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同

岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI(Key Performance Indicator 主要绩效指标)为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

从 2020 年 11 月 16 日至 2020 年 12 月 31 日，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

本基金在第六个开放期（2020 年 11 月 9 日至 2020 年 11 月 27 日）的最后一日日终发生基金净资产低于 5000 万元的情况，触发了基金合同约定的转型条款。根据基金合同的约定，本基金已于 2020 年 12 月 26 日转型为普通开放式基金，基金名称相应变更为“景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金”。

§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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—景顺长城基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基

金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告（转型后）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 21329 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金(原景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金)全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金(原景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金,以下简称“景顺长城景瑞睿利基金”)的财务报表,包括2020年12月31日的资产负债表,2020年12月26日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了景顺长城景瑞睿利基金2020年12月31日的财务状况以及2020年12月26日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

	按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城景瑞睿利基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>景顺长城景瑞睿利基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估景顺长城景瑞睿利基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算景顺长城景瑞睿利基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督景顺长城景瑞睿利基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对景顺长城景瑞睿利基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城景瑞睿利基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重</p>

	大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	陈薇瑶
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2021 年 3 月 24 日	

§6 审计报告（转型前）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 21292 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金(以下简称“景顺长城景瑞睿利定开基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 25 日(基金合同失效前日)的资产负债表,2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 25 日(基金合同失效前日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了景顺长城景瑞睿利定开基金 2020 年 12 月 25 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 25 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于景顺长城景瑞睿利定开基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>景顺长城景瑞睿利定开基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在</p>

	<p>由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估景顺长城景瑞睿利定开基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算景顺长城景瑞睿利定开基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督景顺长城景瑞睿利定开基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对景顺长城景瑞睿利定开基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城景瑞睿利定开基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 陈薇瑶
会计师事务所的地址	中国上海市
审计报告日期	2021年3月24日

§7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	1,023,403.56
结算备付金		120,237.11
存出保证金		6,001.28
交易性金融资产	7.4.7.2	34,961,934.98
其中：股票投资		5,860,899.94
基金投资		-
债券投资		29,101,035.04
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		666,660.16
应收利息	7.4.7.5	438,976.29
应收股利		-
应收申购款		24.03
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		37,217,237.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		170,887.42
应付管理人报酬		32,959.74
应付托管费		8,239.93
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	4,053.30
应交税费		1,949.13
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	134,000.00
负债合计		352,089.52
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	32,004,271.48
未分配利润	7.4.7.10	4,860,876.41
所有者权益合计		36,865,147.89
负债和所有者权益总计		37,217,237.41

注：1. 报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1518 元，基金份额总额 32,004,271.48 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 12 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 12 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 12 月 26 日（基金合同生效日） 至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		214,187.65
1. 利息收入		13,160.43
其中：存款利息收入	7.4.7.11	175.60
债券利息收入		12,984.83
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,641.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	22,067.61
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-23,322.84
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	-386.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	202,661.07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	7.69
减：二、费用		6,829.38

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,126.61
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,531.65
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	376.55
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		30.45
7. 其他费用	7.4.7.19	-1,235.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		207,358.27
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		207,358.27

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 12 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 12 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	32,953,672.61	4,791,137.23	37,744,809.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	207,358.27	207,358.27
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）	-949,401.13	-137,619.09	-1,087,020.22
其中：1. 基金申购款	1,637.58	236.75	1,874.33
2. 基金赎回款	-951,038.71	-137,855.84	-1,088,894.55
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)	32,004,271.48	4,860,876.41	36,865,147.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金（原景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金，以下简称“本基金”）是根据《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基

金合同》的约定，由景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金转型而来。景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金在第六个开放期的最后一日日终发生基金净资产低于 5,000 万元的情况，触发了《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》约定的转型条款。本基金于 2020 年 12 月 26 日由定期开放基金转型为普通开放式基金，基金名称相应变更为“景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金”。修改后的《景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金基金合同》将于同日生效，原《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》于同日失效。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为依法发行的债券(包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、可转换债券(含分离型可转换债券)、中央银行票据、中期票据、短期融资券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、同业存单、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款)等。本基金同时投资于股票(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)、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：对债券资产的投资比例不低于基金资产的 70%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×15%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2021 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 12 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 12 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 12 月 26 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类 金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。 本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表表中以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表表以交易性金融资产列示。 本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。(2) 金融负债的分类 金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产, 取得时发生的相关交易费用计入当期损益; 对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息, 单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产, 按照公允价值进行后续计量; 对于

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券投资在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础

确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	1,023,403.56
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	1,023,403.56

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,604,993.91	5,860,899.94	1,255,906.03
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	29,264,305.97	29,101,035.04
	银行间市场	-	-
	合计	29,264,305.97	29,101,035.04
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	33,869,299.88	34,961,934.98	1,092,635.10

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	201.87
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	54.10
应收债券利息	438,717.62
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	2.70
合计	438,976.29

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	3,878.30
银行间市场应付交易费用	175.00
合计	4,053.30

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	134,000.00
合计	134,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 12 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	32,953,672.61	32,953,672.61
2020 年 12 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	-	-

基金份额折算调整		
2020年12月26日(基金合同生效日)至2020年12月31日未领取红利份额折算调整(若有)	-	-
2020年12月26日(基金合同生效日)至2020年12月31日集中申购募集资金本金及利息	-	-
2020年12月26日(基金合同生效日)至2020年12月31日基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	1,637.58	1,637.58
本期赎回(以“-”号填列)	-951,038.71	-951,038.71
本期末	32,004,271.48	32,004,271.48

注：1、申购含转换入份额，赎回含转换出份额；

2、根据《关于景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金转型为景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金及相关业务规则的提示性公告》，本基金由原景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金转型而来。转型方案实施后，基金份额持有人持有的原景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金份额转为景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	5,408,849.28	-617,712.05	4,791,137.23
本期利润	4,697.20	202,661.07	207,358.27
本期基金份额交易产生的变动数	-155,896.27	18,277.18	-137,619.09
其中：基金申购款	268.92	-32.17	236.75
基金赎回款	-156,165.19	18,309.35	-137,855.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,257,650.21	-396,773.80	4,860,876.41

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年12月26日(基金合同生效日)至2020年12月31日
活期存款利息收入	141.52
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	32.46
其他	1.62
合计	175.60

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年12月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	178,485.00
减：卖出股票成本总额	156,417.39
买卖股票差价收入	22,067.61

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年12月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,250,063.35
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,260,614.70
减：应收利息总额	12,771.49
买卖债券差价收入	-23,322.84

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年12月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	-386.31
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	-386.31

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年12月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	202,661.07
股票投资	104,652.53
债券投资	98,008.54
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	202,661.07

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	7.69
合计	7.69

注：本基金赎回费率按持有期间递减，赎回费总额中不低于 25% 的部分归入基金财产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	376.55
银行间市场交易费用	-
合计	376.55

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	738.00
信息披露费	-2,561.36
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	587.48
合计	-1,235.88

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年12月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
长城证券	178,485.00	100.00

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年12月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
长城证券	166.23	100.00	3,105.12	80.06

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 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等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年12月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日

	日
当期发生的基金应支付的管理费	6,126.61
其中：支付销售机构的客户维护费	2,869.25

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 12 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,531.65

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期末未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期
	2020 年 12 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期	1,023,403.56	141.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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 68.00%。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流动暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人通过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，并按照合约

规定的重新定价日或到期日进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	1,023,403.56	-	-	-	-	-	1,023,403.56
结算备付金	120,237.11	-	-	-	-	-	120,237.11
存出保证金	6,001.28	-	-	-	-	-	6,001.28
交易性金融资产	-	8,014,800.00	12,294,154.10	8,359,969.22	432,111.72	5,860,899.94	34,961,934.98
应收利息	-	-	-	-	-	438,976.29	438,976.29
应收申购款	-	-	-	-	-	24.03	24.03
应收证券清算款	-	-	-	-	-	666,660.16	666,660.16
资产总计	1,149,641.95	8,014,800.00	12,294,154.10	8,359,969.22	432,111.72	6,966,560.42	37,217,237.41
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	170,887.42	170,887.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	32,959.74	32,959.74
应付托管费	-	-	-	-	-	8,239.93	8,239.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,053.30	4,053.30
应交税费	-	-	-	-	-	1,949.13	1,949.13
其他负债	-	-	-	-	-	134,000.00	134,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	352,089.52	352,089.52
利率敏感度缺口	1,149,641.95	8,014,800.00	12,294,154.10	8,359,969.22	432,111.72	-	-

7.4.13.4.1.2 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12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-17,872.98
	市场利率下降 25 个基点	17,905.66

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，

所面临的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：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,860,899.94	15.90
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	5,860,899.94	15.90

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变	
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
	本期末（2020 年 12 月 31 日）	
分析	沪深 300 指数上升 5%	382,192.51
	沪深 300 指数下降 5%	-382,192.51

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 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属于第一层次的余额为 15,876,534.98 元, 属于第二层次的余额为 19,085,400.00 元, 无属于第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2)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。

§7 年度财务报表 (转型前)

7.1 资产负债表

会计主体: 景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金

报告截止日: 2020 年 12 月 25 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 25 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	1,259,672.48	2,289,796.56
结算备付金		120,237.11	170,181.22
存出保证金		6,001.28	16,288.86
交易性金融资产	7.4.7.2	36,176,306.00	85,695,937.72
其中: 股票投资		5,912,664.80	19,644,009.46

基金投资		-	-
债券投资		30,263,641.20	66,051,928.26
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	2,000,316.16
应收利息	7.4.7.5	442,583.64	908,651.23
应收股利		-	-
应收申购款		12,938.56	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		38,017,739.07	91,081,171.75
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月25日	上年度末 2019年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	343,467.04
应付赎回款		98,599.90	-
应付管理人报酬		26,833.13	75,678.07
应付托管费		6,708.28	18,919.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,887.07	23,294.49
应交税费		1,664.97	1,299.93
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	135,235.88	59,000.00
负债合计		272,929.23	521,659.04
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	32,953,672.61	82,241,941.52
未分配利润	7.4.7.10	4,791,137.23	8,317,571.19
所有者权益合计		37,744,809.84	90,559,512.71
负债和所有者权益总计		38,017,739.07	91,081,171.75

注：1. 报告截止日 2020 年 12 月 25 日(基金合同失效前日)，基金份额净值 1.1453 元，基金份额总额 32,953,672.61 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 25 日(基金合同失效前日)止期间。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 25 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 25 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		3,757,575.54	18,892,339.34
1. 利息收入		1,571,358.83	6,456,816.42
其中：存款利息收入	7.4.7.11	21,268.86	37,586.20
债券利息收入		1,524,101.95	6,394,917.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		25,988.02	24,312.49
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,742,129.53	8,773,845.60
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,726,752.58	7,724,186.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	871,759.03	498,703.98
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	143,617.92	550,955.58
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-2,555,936.20	3,661,677.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	23.38	-
减：二、费用		1,177,910.96	3,501,493.98
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	721,472.07	1,409,045.99
2. 托管费	7.4.10.2.2	180,367.97	352,261.46
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	93,008.36	259,849.17
5. 利息支出		11,895.66	1,239,383.82
其中：卖出回购金融资产支出		11,895.66	1,239,383.82
6. 税金及附加		2,539.47	16,481.12

7. 其他费用	7.4.7.19	168,627.43	224,472.42
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,579,664.58	15,390,845.36
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,579,664.58	15,390,845.36

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金

本报告期: 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 25 日

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 25 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)	82,241,941.52	8,317,571.19	90,559,512.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,579,664.58	2,579,664.58
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)	-49,288,268.91	-6,106,098.54	-55,394,367.45
其中: 1. 基金申购款	77,605.08	9,864.35	87,469.43
2. 基金赎回款	-49,365,873.99	-6,115,962.89	-55,481,836.88
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)	32,953,672.61	4,791,137.23	37,744,809.84
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	206,246,332.57	-801,610.33	205,444,722.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,390,845.36	15,390,845.36
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)	-124,004,391.05	-6,271,663.84	-130,276,054.89
其中: 1. 基金申购款	96,983.50	5,170.53	102,154.03
2. 基金赎回款	-124,101,374.55	-6,276,834.37	-130,378,208.92
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）	82,241,941.52	8,317,571.19	90,559,512.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]第 1019 号《关于准予景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金注册的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 457,229,112.87 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 895 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 457,440,479.11 份基金份额,其中认购资金利息折合 211,366.24 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为依法发行的债券(包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、可转换债券(含分离型可转换债券)、中央银行票据、中期票据、短期融资券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、同业存单、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款)等。本基金同时投资于股票(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)、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 70%(开放期开始前 10 个工作日至开放期结束后 10 个工作日内不受前述比例限制),股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%,其中,本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。任一开放期内,本基金持有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。封闭期内不受前述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率× 85%+ 沪深 300 指数收益率×15%。

本基金以定期开放的方式运作。本基金以 6 个月为一个封闭期，封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)6 个月的期间。本基金在相邻两个封闭期之间设置开放期，自封闭期结束之后第一个工作日起进入开放期，每个开放期为 5 至 15 个工作日。封闭期内本基金不接受基金份额的申购和赎回，亦不上市交易。

根据本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2020 年 11 月 30 日发布的《关于景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金转型为景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金及相关业务规则的提示性公告》，本基金在第六个开放期的最后一日日终发生基金净资产低于 5000 万元的情况，触发了《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》约定的转型条款。本基金于 2020 年 12 月 26 日由定期开放基金转型为普通开放式基金，基金名称相应变更为“景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金”。修改后的《景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金基金合同》将于同日生效，原《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》于同日失效。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2021 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

经中国证监会批准，基金管理人景顺长城基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 25 日(基金合同失效前日)止期间的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 2020 年 12 月 25 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 25 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值

变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 25 日(基金合同失效前日)。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类 金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。 本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表外以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。 本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。(2) 金融负债的分类 金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。（2）当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券投资在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足

一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2020 年 12 月 25 日	
	上年度末	
	2019 年 12 月 31 日	
活期存款	1,259,672.48	2,289,796.56
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	1,259,672.48	2,289,796.56

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2020 年 12 月 25 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	4,761,411.30	5,912,664.80	1,151,253.50	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	30,524,920.67	30,263,641.20	-261,279.47
	银行间市场	-	-	-
	合计	30,524,920.67	30,263,641.20	-261,279.47
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	35,286,331.97	36,176,306.00	889,974.03	
项目	上年度末			
	2019 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	16,972,817.00	19,644,009.46	2,671,192.46	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	55,281,160.49	56,035,928.26	754,767.77
	银行间市场	9,996,050.00	10,016,000.00	19,950.00
	合计	65,277,210.49	66,051,928.26	774,717.77
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	82,250,027.49	85,695,937.72	3,445,910.23	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月25日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	60.35	591.75
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	21.64	76.60
应收债券利息	442,500.57	908,133.66
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-158.08
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	1.08	7.30
合计	442,583.64	908,651.23

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月25日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,712.07	19,235.11
银行间市场应付交易费用	175.00	4,059.38
合计	3,887.07	23,294.49

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月25日	上年度末 2019年12月31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	135,235.88	59,000.00
合计	135,235.88	59,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月25日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	82,241,941.52	82,241,941.52
本期申购	77,605.08	77,605.08
本期赎回（以“-”号填列）	-49,365,873.99	-49,365,873.99
- 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	32,953,672.61	32,953,672.61

注：根据《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》及《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金仅能在开放期办理申购或赎回业务，其他时间为封闭期。根据《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金关于2020年4月27日至2020年5月8日第五个开放期开放申购、赎回业务的公告》，本基金第一个开放期时间为2020年4月27日至2020年5月8日；根据《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金关于2020年11月9日至2020年11月27日第六个开放期开放申购、赎回业务的公告》，本基金第二个开放期时间为2020年11月9日至2020年11月27日，其他时间为封闭期。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,891,645.07	1,425,926.12	8,317,571.19
本期利润	5,135,600.78	-2,555,936.20	2,579,664.58
本期基金份额交易产生的变动数	-6,618,396.57	512,298.03	-6,106,098.54
其中：基金申购款	10,697.28	-832.93	9,864.35
基金赎回款	-6,629,093.85	513,130.96	-6,115,962.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,408,849.28	-617,712.05	4,791,137.23

7.4.7.11 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12月25日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	18,211.21	21,010.65

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	2,892.24	16,202.47
其他	165.41	373.08
合计	21,268.86	37,586.20

7.4.7.12 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12月25日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	35,695,220.62	86,564,685.01
减：卖出股票成本总额	31,968,468.04	78,840,498.97
买卖股票差价收入	3,726,752.58	7,724,186.04

7.4.7.13 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12月25日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	96,808,703.79	437,038,852.64
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	94,173,771.72	425,631,303.10
减：应收利息总额	1,763,173.04	10,908,845.56
买卖债券差价收入	871,759.03	498,703.98

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月25日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	143,617.92	550,955.58
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	143,617.92	550,955.58

7.4.7.16 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 12月25日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
1. 交易性金融资产	-2,555,936.20	3,661,677.32
股票投资	-1,519,938.96	4,315,210.42
债券投资	-1,035,997.24	-653,533.10
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	-2,555,936.20	3,661,677.32

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 25日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	23.38	-
合计	23.38	-

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金财产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 25日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	92,133.36	254,349.17
银行间市场交易费用	875.00	5,500.00
合计	93,008.36	259,849.17

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 25日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	44,262.00	50,000.00
信息披露费	82,561.36	120,000.00
证券出借违约金	-	-

债券托管账户维护费	36,812.52	37,200.00
银行划款手续费	4,991.55	17,272.42
合计	168,627.43	224,472.42

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

《景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金基金合同》自 2020 年 12 月 26 日起生效，《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》自同一起失效，同时本基金更名为景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年12月25日		2019年1月1日至2019年12月31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	38,137,949.59	69.57	86,207,297.61	52.74

7.4.10.1.2 权证交易

本基金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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
	2020年1月1日至2020年12月25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	35,518.04	69.57	2,938.89	79.17
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	80,284.18	52.73	16,678.76	86.71

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 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等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月25日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	721,472.07	1,409,045.99
其中：支付销售机构的客户维护费	324,338.70	624,579.92

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月25日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	180,367.97	352,261.46

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月25日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期	1,259,672.48	18,211.21	2,289,796.56	21,010.65

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末(2020年12月25日)本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本期末，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 66.84%（上年末：48.93%）。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人通过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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年12月25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	1,259,672.48	-	-	-	-	-	1,259,672.48
结算备付金	120,237.11	-	-	-	-	-	120,237.11
存出保证金	6,001.28	-	-	-	-	-	6,001.28
交易性金融资产	-	8,015,400.00	13,292,252.00	8,296,409.12	659,580.08	5,912,664.80	36,176,306.00
应收利息	-	-	-	-	-	442,583.64	442,583.64
应收申购款	-	-	-	-	-	12,938.56	12,938.56
资产总计	1,385,910.87	8,015,400.00	13,292,252.00	8,296,409.12	659,580.08	6,368,187.00	38,017,739.07
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	98,599.90	98,599.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	26,833.13	26,833.13

应付托管费	-	-	-	-	-	6,708.28	6,708.28
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,887.07	3,887.07
应交税费	-	-	-	-	-	1,664.97	1,664.97
其他负债	-	-	-	-	-	135,235.88	135,235.88
负债总计	-	-	-	-	-	272,929.23	272,929.23
利率敏感度缺口	1,385,910.87	8,015,400.00	13,292,252.00	8,296,409.12	659,580.08	-	-
上年度末 2019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	2,289,796.56	-	-	-	-	-	2,289,796.56
结算备付金	170,181.22	-	-	-	-	-	170,181.22
存出保证金	16,288.86	-	-	-	-	-	16,288.86
交易性金融资产	-	2,910,440.00	37,195,556.80	17,643,293.74	8,302,637.72	19,644,009.46	85,695,937.72
应收利息	-	-	-	-	-	908,651.23	908,651.23
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,000,316.16	2,000,316.16
资产总计	2,476,266.64	2,910,440.00	37,195,556.80	17,643,293.74	8,302,637.72	22,552,976.85	91,081,171.75
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	75,678.07	75,678.07
应付托管费	-	-	-	-	-	18,919.51	18,919.51
应付证券清算款	-	-	-	-	-	343,467.04	343,467.04
应付交易费用	-	-	-	-	-	23,294.49	23,294.49
应交税费	-	-	-	-	-	1,299.93	1,299.93
其他负债	-	-	-	-	-	59,000.00	59,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	521,659.04	521,659.04
利率敏感度缺口	2,476,266.64	2,910,440.00	37,195,556.80	17,643,293.74	8,302,637.72	-	-

7.4.13.4.1.2 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12月25日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率上升25个基点	-20,269.50	-60,494.78
	市场利率下降25个基点	20,307.14	60,638.77

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场

价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月25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	5,912,664.80	15.66	19,644,009.46	21.69
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	5,912,664.80	15.66	19,644,009.46	21.69

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保存不变		
	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12月25日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	399,256.33	896,110.86
	沪深 300 指数下降 5%	-399,256.33	-896,110.86

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 25 日(基金合同失效前日)，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 16,088,106.00 元，属于第二层次的余额为 20,088,200.00 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 42,811,672.88 元，第二层次 42,884,264.84 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 25 日(基金合同失效前日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 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。

§8 投资组合报告（转型后）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,860,899.94	15.75
	其中：股票	5,860,899.94	15.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,101,035.04	78.19

	其中：债券	29,101,035.04	78.19
	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	1,143,640.67	3.07
8	其他各项资产	1,111,661.76	2.99
9	合计	37,217,237.41	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,060,043.34	11.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	145,231.60	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	749,277.00	2.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	159,273.00	0.43
J	金融业	-	-
K	房地产业	266,910.00	0.72
L	租赁和商务服务业	480,165.00	1.30
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,860,899.94	15.90

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601888	中国中免	1,700	480,165.00	1.30
2	002352	顺丰控股	5,000	441,150.00	1.20
3	000625	长安汽车	20,100	439,788.00	1.19
4	300482	万孚生物	4,200	374,682.00	1.02
5	300073	当升科技	5,700	369,645.00	1.00
6	300568	星源材质	12,014	363,663.78	0.99
7	000858	五粮液	1,200	350,220.00	0.95
8	300037	新宙邦	3,400	344,760.00	0.94
9	000725	京东方A	56,700	340,200.00	0.92
10	000651	格力电器	5,200	322,088.00	0.87
11	603885	吉祥航空	27,100	308,127.00	0.84
12	000002	万科A	9,300	266,910.00	0.72
13	002841	视源股份	2,252	259,047.56	0.70
14	000063	中兴通讯	7,200	242,280.00	0.66
15	300580	贝斯特	11,200	227,472.00	0.62
16	600585	海螺水泥	4,100	211,642.00	0.57
17	002233	塔牌集团	16,600	211,484.00	0.57
18	002555	三七互娱	5,100	159,273.00	0.43
19	002727	一心堂	4,360	145,231.60	0.39
20	300207	欣旺达	100	3,071.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	107,817.00	0.29
2	300568	星源材质	70,668.00	0.19

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	-
卖出股票收入（成交）总额	178,485.00

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,033,200.00	10.94
	其中：政策性金融债	4,033,200.00	10.94
4	企业债券	15,052,200.00	40.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,015,635.04	27.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,101,035.04	78.94

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	108604	国开 1805	40,000	4,033,200.00	10.94
2	136233	16 保利 03	30,000	3,004,200.00	8.15
3	136318	16 中油 05	30,000	3,001,800.00	8.14
4	132007	16 凤凰 EB	21,590	2,223,554.10	6.03
5	143732	18 国君 G3	20,000	2,016,000.00	5.47

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

1、国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书(银保监罚决字(2020)67号)。其因为违规的政府购买服务项目提供融资等多项违法违规行，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则规定，被处以罚款 4880 万元罚款。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对国家开发银行债券进行了投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,001.28
2	应收证券清算款	666,660.16
3	应收股利	-
4	应收利息	438,976.29
5	应收申购款	24.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,111,661.76

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132007	16 凤凰 EB	2,223,554.10	6.03
2	110053	苏银转债	1,421,453.80	3.86
3	113021	中信转债	1,056,308.40	2.87
4	132009	17 中油 EB	1,012,900.00	2.75
5	113011	光大转债	827,518.40	2.24
6	132015	18 中油 EB	503,000.00	1.36
7	113017	吉视转债	410,932.50	1.11
8	110064	建工转债	390,327.60	1.06
9	113516	苏农转债	346,134.30	0.94
10	110059	浦发转债	245,338.00	0.67

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§8 投资组合报告（转型前）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,912,664.80	15.55
	其中：股票	5,912,664.80	15.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,263,641.20	79.60
	其中：债券	30,263,641.20	79.60
	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	1,379,909.59	3.63
8	其他各项资产	461,523.48	1.21
9	合计	38,017,739.07	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
----	------	---------	---------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,081,593.40	10.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	146,234.40	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	733,270.00	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	143,157.00	0.38
J	金融业	-	-
K	房地产业	368,110.00	0.98
L	租赁和商务服务业	440,300.00	1.17
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,912,664.80	15.66

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300568	星源材质	14,314	472,362.00	1.25
2	000625	长安汽车	20,100	443,607.00	1.18
3	601888	中国中免	1,700	440,300.00	1.17
4	002352	顺丰控股	5,000	429,750.00	1.14
5	300482	万孚生物	4,200	381,318.00	1.01
6	000002	万科A	13,100	368,110.00	0.98
7	300073	当升科技	5,700	352,830.00	0.93
8	300037	新宙邦	3,400	344,250.00	0.91
9	000858	五粮液	1,200	331,104.00	0.88
10	000725	京东方A	56,700	322,623.00	0.85
11	000651	格力电器	5,200	307,892.00	0.82
12	603885	吉祥航空	27,100	303,520.00	0.80

13	002841	视源股份	2,252	244,792.40	0.65
14	300580	贝斯特	11,200	234,304.00	0.62
15	000063	中兴通讯	7,200	223,488.00	0.59
16	002233	塔牌集团	16,600	210,322.00	0.56
17	600585	海螺水泥	4,100	209,674.00	0.56
18	002727	一心堂	4,360	146,234.40	0.39
19	002555	三七互娱	5,100	143,157.00	0.38
20	300207	欣旺达	100	3,027.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	2,252,683.00	2.49
2	000725	京东方A	1,725,188.00	1.91
3	002233	塔牌集团	1,168,658.00	1.29
4	603338	浙江鼎力	921,069.00	1.02
5	002511	中顺洁柔	898,230.00	0.99
6	300450	先导智能	894,385.84	0.99
7	603239	浙江仙通	892,741.00	0.99
8	600585	海螺水泥	796,195.00	0.88
9	600383	金地集团	732,992.00	0.81
10	603885	吉祥航空	696,789.00	0.77
11	002056	横店东磁	684,838.00	0.76
12	000651	格力电器	623,383.00	0.69
13	002965	祥鑫科技	607,420.57	0.67
14	000977	浪潮信息	562,948.80	0.62
15	002928	华夏航空	525,238.00	0.58
16	000625	长安汽车	499,504.00	0.55
17	002841	视源股份	457,566.00	0.51
18	601668	中国建筑	453,224.00	0.50
19	002555	三七互娱	413,313.00	0.46
20	000063	中兴通讯	407,997.00	0.45

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600383	金地集团	2,355,158.00	2.60
2	000651	格力电器	1,895,715.58	2.09
3	300568	星源材质	1,888,789.00	2.09
4	300482	万孚生物	1,789,865.21	1.98

5	300450	先导智能	1,770,687.00	1.96
6	600028	中国石化	1,744,573.00	1.93
7	002841	视源股份	1,594,935.50	1.76
8	000002	万科A	1,556,137.00	1.72
9	300383	光环新网	1,429,001.00	1.58
10	000977	浪潮信息	1,295,883.60	1.43
11	600673	东阳光	1,223,745.00	1.35
12	000725	京东方A	1,223,706.00	1.35
13	603338	浙江鼎力	1,142,684.00	1.26
14	002353	杰瑞股份	1,054,677.00	1.16
15	002511	中顺洁柔	1,024,104.00	1.13
16	002233	塔牌集团	1,020,778.00	1.13
17	603239	浙江仙通	997,010.00	1.10
18	600048	保利地产	974,401.00	1.08
19	002727	一心堂	872,979.00	0.96
20	600887	伊利股份	851,812.00	0.94

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	19,757,062.34
卖出股票收入（成交）总额	35,695,220.62

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,036,000.00	13.34
	其中：政策性金融债	5,036,000.00	13.34
4	企业债券	15,052,200.00	39.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,175,441.20	26.96
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,263,641.20	80.18

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	108604	国开 1805	50,000	5,036,000.00	13.34
2	136233	16 保利 03	30,000	3,004,500.00	7.96
3	136318	16 中油 05	30,000	3,001,500.00	7.95
4	132007	16 凤凰 EB	21,590	2,219,452.00	5.88
5	143732	18 国君 G3	20,000	2,016,000.00	5.34

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

1、国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书(银保监罚决字〔2020〕67 号)。其因为违规的政府购买服务项目提供融资等多项违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则规定，被处以罚款 4880 万元罚款。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程

序对国家开发银行债券进行了投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,001.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	442,583.64
5	应收申购款	12,938.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	461,523.48

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132007	16 凤凰 EB	2,219,452.00	5.88
2	110053	苏银转债	1,407,142.10	3.73
3	113021	中信转债	1,050,485.20	2.78
4	132009	17 中油 EB	1,012,900.00	2.68
5	113011	光大转债	815,628.00	2.16
6	132015	18 中油 EB	502,500.00	1.33
7	113017	吉视转债	397,545.00	1.05
8	110064	建工转债	384,139.20	1.02
9	113516	苏农转债	338,334.00	0.90
10	110059	浦发转债	244,157.10	0.65
11	113563	柳药转债	231,034.40	0.61

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,225	14,383.94	3,045,451.79	9.52	28,958,819.69	90.48

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	21.07	0.00

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

1. 本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
2. 本期末本基金的基金经理未持有本基金。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,257	14,600.65	3,045,451.79	9.24	29,908,220.82	90.76

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	21.07	0.00

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

1. 本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
2. 本期末本基金的基金经理未持有本基金。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§10 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2020 年 12 月 26 日）基金份额总额	32,953,672.61
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,637.58
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	951,038.71
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	32,004,271.48

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

基金合同生效日（2017 年 9 月 27 日）基金份额总额	457,440,479.11
本报告期期初基金份额总额	82,241,941.52
本报告期基金总申购份额	77,605.08
减：本报告期基金总赎回份额	49,365,873.99
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	32,953,672.61

注：根据《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金关于 2020 年 4 月 27 日至 2020 年 5 月 8 日第五个开放期开放申购、赎回业务的公告》，本基金第一个开放期时间为 2020 年 4 月 27 日至 2020 年 5 月 8 日；根据《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金关于 2020 年 11 月 9 日至 2020 年 11 月 27 日第六个开放期开放申购、赎回业务的公告》，本基金第二个开放期时间为 2020 年 11 月 9 日至 2020 年 11 月 27 日，其他时间为封闭期。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 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。本基金管理人于 2020 年 9 月 12 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，聘任李进先生担任本公司董事长。本基金管理人于 2020 年 10 月 16 日发布公告，经深圳市市场监督管理局核准，景顺长城基金管理有限公司法定代表人变更为李进先生。

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：

2020 年 8 月，中国农业银行总行决定刘琳任托管业务部副总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

1、根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及本基金基金合同、更新招募说明书等规定，经与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对本基金参与存托凭证投资修订基金合同等法律文件，包括明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法等，并在基金合同、基金招募说明书（更新）、产品资料概要中增加投资存托凭证的风险揭示。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 2020 年 11 月 4 日起正式生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 11 月 4 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同等法律文件的公告》。

2、自 2020 年 12 月 26 日起，“景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金”转型为“景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金”，《基金合同》相应删除了期限配置策略等相关内容。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 11 月 30 日至 2020 年 12 月 28 日发

布的一系列公告。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 3 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 45,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人分管副总经理由于信息技术业务人员未对系统测试结果进行审查，致使公司旗下个别基金出现拉抬股价的异常交易情形，收到深圳证监局监管谈话的决定。本报告期内，本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券股份有限公司	1	178,485.00	100.00%	166.23	100.00%	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
国盛证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股 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	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 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	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
申港证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限	2	-	-	-	-	-

公司						
中泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

2、本基金本期交易单元未发生变化。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券股份有限公司	1,007,830.00	81.42%	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

川财证券 有限责任 公司						
大同证券 有限责任 公司						
东北证券 股份有限 公司						
东方证券 股份有限 公司						
东兴证券 股份有限 公司						
方正证券 股份有限 公司						
光大证券 股份有限 公司	229,953.90	18.58%				
广发证券 股份有限 公司						
国金证券 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						
国信证券 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						
华创证券 有限责任						

公司						
华福证券 有限责任 公司						
华泰证券 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						
瑞银证券 有限责任 公司						
申港证券 股份有限 公司						
申万宏源 证券有限 公司						
天风证券 股份有限 公司						
西南证券 股份有限 公司						
新时代证 券股份有 限公司						
兴业证券 股份有限 公司						
招商证券 股份有限 公司						
中国国际 金融股份 有限公司						
中国银河 证券股份 有限公司						
中泰证券						

股份有限公司						
中信建投证券股份有限公司						
中信证券股份有限公司						

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券股份有限公司	1	38,137,949.59	69.57%	35,518.04	69.57%	-
光大证券股份有限公司	2	16,684,700.80	30.43%	15,537.68	30.43%	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证	1	-	-	-	-	-

券股份有限 公司							
国信证券股 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	-	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 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	2	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-	-
申港证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-	本期 新增
申万宏源证 券有限公司	1	-	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
西南证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	2	-	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-	-
中信建投证	1	-	-	-	-	-	-

券股份有限 公司						
中信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券 股份有限 公司	11,489,090.20	15.89%	4,000,000.00	1.25%	-	-
光大证券 股份有限 公司	60,808,292.80	84.11%	316,000,000.00	98.75%	-	-
安信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
川财证券 有限责任	-	-	-	-	-	-

公司						
大同证券 有限责任 公司						
东北证券 股份有限 公司						
东方证券 股份有限 公司						
东兴证券 股份有限 公司						
方正证券 股份有限 公司						
广发证券 股份有限 公司						
国金证券 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						
国信证券 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						
华创证券 有限责任 公司						
华福证券 有限责任 公司						
华泰证券						

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						
瑞银证券 有限责任 公司						
申港证券 股份有限 公司						
申万宏源 证券有限 公司						
天风证券 股份有限 公司						
西南证券 股份有限 公司						
新时代证 券股份有 限公司						
兴业证券 股份有限 公司						
招商证券 股份有限 公司						
中国国际 金融股份 有限公司						
中国银河 证券股份 有限公司						
中泰证券 股份有限 公司						
中信建投 证券股份 有限公司						

中信证券 股份有限 公司						
--------------------	--	--	--	--	--	--

11.8 其他重大事件（转型后）

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《景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金基金合同》生效的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-26
2	景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-26
3	景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-26
4	景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-26
5	景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-26
6	关于景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金参加部分销售机构申购及/或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	2020-12-28
7	景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金关于开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-28
8	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金在直销网上交易系统开展转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-28
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-31
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加苏州银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-31
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-31

11.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行基金申购、定期定额投资及基金组合产品申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-06

2	景顺长城景瑞睿利回报定期开放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	2020-01-21
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	2020-01-21
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	2020-01-22
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	2020-01-30
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	2020-01-31
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	2020-02-03
8	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	2020-02-06
9	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	2020-03-06
10	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	2020-03-19
11	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	2020-03-20
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加鼎信汇金（北京）投资管理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	2020-03-25
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-25
14	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	2020-03-30
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险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	2020-03-31
16	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	2020-04-07

17	景顺长城基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-08
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加万联证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-10
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万联证券为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-10
20	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	2020-04-20
21	景顺长城景瑞睿利回报定期开放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	2020-04-20
22	景顺长城景瑞睿利回报定期开放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	2020-04-22
23	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金关于 2020 年 4 月 27 日至 2020 年 5 月 8 日第五个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-22
24	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	2020-04-22
25	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金关于 2020 年 4 月 27 日至 2020 年 5 月 8 日第五个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-23
26	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金关于 2020 年 4 月 27 日至 2020 年 5 月 8 日第五个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-24
27	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	2020-04-29
28	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	2020-04-30
29	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	2020-05-15
30	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	2020-05-28
31	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京汇成基金销售有限公司基金申购及转换费率优惠活动的	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-01

	公告		
32	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-01
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	2020-07-02
34	景顺长城基金管理有限公司关于直销 APP 交易系统相关服务的提示	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-07
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	2020-07-09
36	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信证券等多家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	2020-07-20
37	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-21
38	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-21
39	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-31
40	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加渤海银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-31
41	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加申万宏源西部证券有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-17
42	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加申万宏源证券有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-17
43	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-24
44	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金 2020 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-24
45	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金披露基金产品资料概要（更新）的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-31
46	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-31
47	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	2020-09-12
48	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-19

49	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-21
50	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-24
51	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	2020-09-26
52	景顺长城基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-16
53	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-16
54	景顺长城基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-21
55	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华鑫证券有限责任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	2020-10-23
56	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-27
57	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-27
58	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-30
59	景顺长城基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-03
60	景顺长城基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-04
61	景顺长城景瑞睿利回报定期开放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	2020-11-04
62	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-04
63	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-04
64	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-04
65	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金关于 2020 年 11 月 9 日至 2020 年 11 月 27 日第六个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-05

66	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	2020-11-05
67	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金关于 2020 年 11 月 9 日至 2020 年 11 月 27 日第六个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-06
68	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金关于 2020 年 11 月 9 日至 2020 年 11 月 27 日第六个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-07
69	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	2020-11-13
70	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国泰君安证券为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”及基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-19
71	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	2020-11-26
72	关于景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金转型为景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金及相关业务规则的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-30
73	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金 2020 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-30
74	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-30
75	关于景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金转型过渡期赎回费率的补充公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-01
76	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	2020-12-03
77	景顺长城基金管理有限公司关于终止盈信基金等公司办理相关业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-22
78	景顺长城基金管理有限公司关于终止北京电盈基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-24

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及本基金基金合同、更新招募说明书等规定，经与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对本基金参与存托凭证投资修订基金合同等法律文件，包括明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法等，并在基金合同、基金招募说明书（更新）、产品资料概要中增加投资存托凭证的风险揭示。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 2020 年 11 月 4 日起正式生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 11 月 4 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同等法律文件的公告》。

2、景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金在第六个开放期（2020 年 11 月 9 日至 2020 年 11 月 27 日）的最后一日日终发生基金净资产低于 5000 万元的情况，触发了基金合同约定的转型条款，该基金自 2020 年 12 月 26 日转型为景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金（以下简称“景瑞睿利回报混合基金”）。因 2020 年 12 月 26 日非交易日，景瑞睿利回报混合基金于 2020 年 12 月 28 日开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 11 月 30 日至 2020 年 12 月 28 日发布的一系列公告。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》、《景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金招募说明书》、《景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金托管协议》、《景顺长城景瑞睿利回报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。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2021年3月29日