

# 景顺长城泰申回报混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 23 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	44

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	44
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12 投资组合报告附注 .....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	50
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城泰申回报混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城泰申回报混合
基金主代码	008479
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 18 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	685,025,739.36 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，寻求基金资产的长期稳健增值，力争获得超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	<p>本基金主要通过资产配置方案观点，采用债券投资策略及股票投资策略双策略搭配。在严格控制风险的前提下，追求获得稳定的投资回报。</p> <p>本基金采用的投资策略主要包括：</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，重点关注包括、GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析和充分论证的基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>2、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>4、股票投资策略</p> <p>本基金通过基金经理的战略性选股思路以及投研部门的支持，筛选出价值优势明显的优质股票构建股票投资组合。</p>
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%

风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
--------	---

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳	周直毅
	联系电话	0755-82370388	021-68475608
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@bosc.cn
客户服务电话		4008888606	95594
传真		0755-22381339	021-68476936
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 42 层
邮政编码		518048	200120
法定代表人		李进	金煜

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

### 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	26,677,603.63
本期利润	18,352,805.18
加权平均基金份额本期利润	0.0364
本期加权平均净值利润率	3.30%
本期基金份额净值增长率	3.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	80,615,167.05
期末可供分配基金份额利润	0.1177
期末基金资产净值	767,376,778.29
期末基金份额净值	1.1202

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	12.02%

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

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

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

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

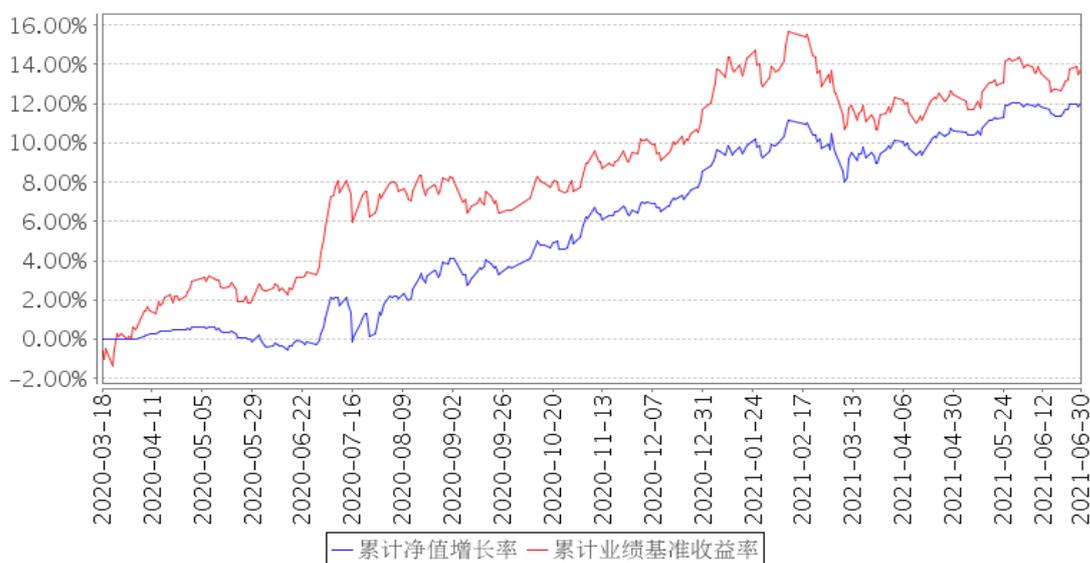
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.04%	0.12%	-0.47%	0.25%	0.43%	-0.13%
过去三个月	2.07%	0.16%	1.96%	0.30%	0.11%	-0.14%
过去六个月	3.19%	0.27%	1.82%	0.40%	1.37%	-0.13%
过去一年	12.11%	0.30%	9.66%	0.40%	2.45%	-0.10%
自基金合同生效起至今	12.02%	0.27%	13.75%	0.38%	-1.73%	-0.11%

### 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

景顺长城泰申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：本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-50%。投资于同业存单比例不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2020 年 3 月 18 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。报告期末距离建仓结束期未满一年。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万梦	本基金的基金经理	2020 年 3 月 18 日	-	10 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、基金经理助理，自 2015 年 7 月起担任固定收益部基金经理。具有 10 年证券、基金行业从业经验。
陈莹	本基金的基金经理	2020 年 7 月 10 日	-	7 年	工学硕士。曾任交通银行公司机构部高级行业经理，浙商基金管理有限公司固定收益部信用评级研究员，华安基金管理有限公司固定收益部信用分析师。2019 年 11 月加入本公司，历任固定收益部信用研究员、基金经理助理，自 2020 年 7 月起担任固定收益部基金经理。具有 7 年证券、基金行业从业经验。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城泰申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 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，以美国英国为代表的部分发达国家受益于疫苗接种率快速提升，疫情得到有效控制，海外经济整体处于修复过程之中，在 5 月份全球制造业 PMI 报 56 创新高之后，6 月边际下滑至 55.5，按照中国的经验，疫情低点到高点大致经历 3 个季度，如果经验可借鉴，可以大致判断包括美国在内的全球经济修复可能目前已经处于顶部区间，扩张动能后续可能逐步减缓。国内方面，一季度经济复苏保持惯性，出口及房地产投资仍是主要支撑力量，二季度经济增速开始出现环比放缓迹象，受益于较好的出口以及较强韧性的房地产投资，经济下行趋势比较平缓；其中，受局部疫情反复、居民收入恢复不均，国内消费恢复节奏偏慢，但整体方向保持向上，呈现缓慢复苏态势；之前被市场寄予厚望的制造业投资受高企的原材料价格以及偏低的财政支出影响，回升速度较慢。整体而言，国内经济惯性仍在，但扩张动力已出现边际放缓。

货币政策方面，美联储在最新一次议息会议中基调转“鹰”，除了调高通胀与经济预期之外，还对 Tapper 进行了讨论，点阵图显示 2023 年底之前将加息 2 次，政策收紧预期升温。而中国央行则维持偏“稳”的政策基调，由于地方专项债发行滞后以及贸易持续盈余，2 月之后货币市场保持宽松。

债券市场方面，一季度受到资金面波动、通胀预期的影响，债券收益率冲高回落，整体上趋于上行，信用债市场出现风险偏好降低和信用边际收紧迹象；二季度受持续宽松的资金面及环比走弱的经济基本面推动，债券收益率持续下行，信用利差也不断压缩。上半年，1 年期国债和 1 年期国开债相较于去年底分别下行 4.5BP 和 11BP 至 2.43% 和 3.08%。

权益市场方面，上半年整体呈现结构性行情。春节前，在央行维稳流动性宽裕呵护下，叠加新基金发行火热，市场情绪较为高涨，核心资产带领指数大涨；春节后，随着疫情趋于稳定，海外大宗商品价格大幅上涨，通胀预期的上行及美债收益率的快速跳升使市场估值承受压力，特别是估值较高的核心资产，开始呈现抱团瓦解趋势，连续大幅下跌；二季度指数整体反弹为主，但行业分化严重：受产品价格涨价带动，以煤炭、有色、化工为代表的顺周期行业表现突出，同时，持续高景气的新能源行业、半导体、医药行业继一季度抛售后，在二季度也出现大幅反弹；而部分短期景气度较弱的行业和个股则跌幅较大。上半年，上证指数上涨 3.4%，沪深 300 上涨 0.24%，创业板指涨 17.22%破前期高点。

上半年组合债券部分整体拉长了久期，并维持较低的杠杆水平。权益部分以绝对收益为主要思路，结构上以稳健低估值品种为主，辅以一部分中长期景气度较为确认的估值相对合理的成长品种。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年上半年，本基金份额净值增长率为 3.19%，业绩比较基准收益率为 1.82%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，三季度美联储货币政策进入一个敏感时点，未来美联储或将释放关于减少债券资产购买的政策指引，海外市场流动性也将面临一定的边际收紧。中国央行上半年整体维持偏“稳”的政策基调，而近期超预期的全面降准主要是预防性的，国内经济基本面虽然边际走弱但仍有韧性；往后看，国内货币政策偏“稳”的政策基调预计不会有大的变化。

债券市场方面，展望下半年，国内经济动能边际走弱，叠加偏“稳”的货币政策基调，总体来看，我们对于国内债券市场保持谨慎乐观的态度。组合操作上，仍计划以中短久期高等级信用债为主，在信用市场风险偏好未出现明显改善前，不进行过多信用下沉，对弱资质主体保持谨慎；若后续由于政府债券供给压力增加导致收益率出现明显调整，则可能是年内较好的配置时点，适当拉长久期，增厚组合收益。

权益市场方面，当前宏观场景制约权益市场整体估值提升带来的趋势性机会，宏观经济运行情况和政策的边际变化是影响当前市场走势的核心矛盾，对此应保持高度关注，需要进行紧密跟踪。整体来看，我们对后市观点偏中性：一方面，中国经济增长惯性仍在，且预计政策面将相机而动，国内经济快速回落的风险并不大；另一方面，二季度以来流动性超预期宽松，通胀预期回落，市场估值水平迅速修复，龙头股经历了一波大幅的反弹，部分股票已经创下年内新高，二季度创业板指涨 26%，破前期高点，存在一定的估值风险，预期未来市场仍会有较大波动。配置思路方面，寻找估值和景气度相匹配的板块，关注个股估值的安全边际，逢低吸纳代表消费升级及

产业升级趋势的优质龙头。组合配置方向上，一方面以中低估值的金融、公用事业、家电家居、  
交运、汽车零部件为主，另一方面，少量配置部分业绩确定性强的消费龙头以及估值合理的具备  
中长期景气度的优质成长，如汽车电动化智能化产业链、5G 应用落地带动可穿戴相关的消费电子  
产业链、军工产业链等。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城泰申回报混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,529,436.93	1,462,771.18
结算备付金		527,718.59	662,748.31
存出保证金		104,230.93	129,790.51
交易性金融资产	6.4.7.2	784,666,195.58	783,638,527.59
其中：股票投资		125,206,067.86	127,882,648.71
基金投资		-	-
债券投资		659,460,127.72	655,755,878.88
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	20,995,210.50	10,000,000.00
应收证券清算款		461,057.66	648,281.32
应收利息	6.4.7.5	9,868,963.18	10,322,486.52

应收股利		-	-
应收申购款		999.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		819,153,812.37	806,864,605.43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		50,599,865.00	116,151,425.77
应付证券清算款		528,142.03	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		353,335.57	345,693.45
应付托管费		58,889.28	57,615.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	83,168.05	67,812.92
应交税费		56,203.20	50,349.76
应付利息		1,650.50	48,698.28
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	95,780.45	64,000.00
负债合计		51,777,034.08	116,785,595.76
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	685,025,739.36	635,657,446.53
未分配利润	6.4.7.10	82,351,038.93	54,421,563.14
所有者权益合计		767,376,778.29	690,079,009.67
负债和所有者权益总计		819,153,812.37	806,864,605.43

注：1. 报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1202 元，基金份额总额 685,025,739.36 份。

2. 本基金合同生效日 2020 年 3 月 18 日，上年度可比期间为 2020 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城泰申回报混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 3 月 18 日(基金合 同生效日)至 2020 年 6 月

			30 日
一、收入		21,304,724.71	-121,195.46
1. 利息收入		8,876,127.71	2,157,499.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	35,563.53	212,118.16
债券利息收入		8,713,287.14	1,752,826.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		127,277.04	192,555.15
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,639,258.64	909,172.48
其中：股票投资收益	6.4.7.12	22,274,875.67	89,097.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,259,189.09	-25,450.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	623,572.06	845,525.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-8,324,798.45	-4,229,816.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	114,136.81	1,041,949.19
减：二、费用		2,951,919.53	961,222.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,672,700.88	571,187.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	278,783.46	95,197.79
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	348,293.84	128,396.40
5. 利息支出		512,985.50	128,151.69
其中：卖出回购金融资产支出		512,985.50	128,151.69
6. 税金及附加		27,198.60	5,024.82
7. 其他费用	6.4.7.19	111,957.25	33,265.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,352,805.18	-1,082,418.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,352,805.18	-1,082,418.29

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城泰申回报混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	635,657,446.53	54,421,563.14	690,079,009.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,352,805.18	18,352,805.18
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）	49,368,292.83	9,576,670.61	58,944,963.44
其中：1. 基金申购款	521,116,862.24	56,711,880.17	577,828,742.41
2. 基金赎回款	-471,748,569.41	-47,135,209.56	-518,883,778.97
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）	685,025,739.36	82,351,038.93	767,376,778.29
项目	上年度可比期间 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	219,826,093.26	-	219,826,093.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,082,418.29	-1,082,418.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	150,949,584.41	817,454.58	151,767,038.99

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	348,695,550.33	1,394,675.78	350,090,226.11
2. 基金赎回款	-197,745,965.92	-577,221.20	-198,323,187.12
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）	370,775,677.67	-264,963.71	370,510,713.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城泰申回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2397 号文《关于准予景顺长城泰申回报混合型证券投资基金注册批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城泰申回报混合型证券投资基金基金合同》作为发起人于 2020 年 3 月 9 日至 2020 年 3 月 13 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2020)验字第 60467014\_H02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 3 月 18 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 219,775,876.29 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 50,216.97 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 219,826,093.26 元，折合 219,826,093.26 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票及存托凭证）、股指期货、国债期货、股票期权、债券（包括但不限于国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换

债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券及其他经中国证监会允许投资的债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、现金,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,但须符合中国证监会的相关规定。本基金还可以参与融资业务。

本基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-50%。投资于同业存单比例不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰,由出让方缴纳。

## （2）增值税及附加、企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自 2018 年 1 月 1 日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下称资管产品运营业务),暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的,资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

## （3）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发

行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	2,529,436.93
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	2,529,436.93

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	116,092,092.77	125,206,067.86	9,113,975.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	222,743,127.72	-1,193,153.91
	银行间市场	436,717,000.00	-1,402,364.62
	合计	659,460,127.72	-2,595,518.53
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	778,147,739.02	784,666,195.58	6,518,456.56

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	20,995,210.50	-
合计	20,995,210.50	-

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	1,110.02
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	213.75
应收债券利息	9,859,179.62
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	8,417.58
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	42.21
合计	9,868,963.18

## 6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末的其他资产余额为零。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	74,998.02
银行间市场应付交易费用	8,170.03
合计	83,168.05

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	95,780.45
合计	95,780.45

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	635,657,446.53	635,657,446.53
本期申购	521,116,862.24	521,116,862.24
本期赎回（以“-”号填列）	-471,748,569.41	-471,748,569.41
- 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	685,025,739.36	685,025,739.36

注：本报告期申购份额包含基金转入份额；本报告期赎回份额包含基金转出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,423,193.32	13,998,369.82	54,421,563.14
本期利润	26,677,603.63	-8,324,798.45	18,352,805.18
本期基金份额交易产生的变动数	13,514,370.10	-3,937,699.49	9,576,670.61
其中：基金申购款	52,211,625.20	4,500,254.97	56,711,880.17
基金赎回款	-38,697,255.10	-8,437,954.46	-47,135,209.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	80,615,167.05	1,735,871.88	82,351,038.93

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	26,359.45
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	8,411.68
其他	792.40
合计	35,563.53

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	108,750,650.69
减：卖出股票成本总额	86,475,775.02
买卖股票差价收入	22,274,875.67

## 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	457,343,922.76
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	450,902,932.39
减：应收利息总额	8,700,179.46
买卖债券差价收入	-2,259,189.09

## 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具收益。

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	623,572.06
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	623,572.06

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-8,324,798.45
股票投资	-11,703,476.17
债券投资	3,378,677.72
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	-8,324,798.45

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	114,136.81
合计	114,136.81

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	340,368.84
银行间市场交易费用	7,925.00
合计	348,293.84

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	18,600.00
银行划款手续费	6,576.80
合计	111,957.25

#### 6.4.7.20 分部报告

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

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

本基金于本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年3月18日（基金合 同生效日）至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,672,700.88	571,187.09
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的0.60%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	278,783.46	95,197.79

注：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

上海银行一定期存款	-	-	-	25,200.00
上海银行一活期存款	2,529,436.93	26,359.45	1,561,827.41	118,840.27

注：本基金的活期银行存款和部分定期存款由基金托管人上海银行保管，活期存款按银行同业利率计息，定期存款按协议利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内均未参与关联方承销的证券投资。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期末未进行利润分配。

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

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-

300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股流通受限	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021年6月4日	2021年8月25日	新股流通受限	-	27.42	108	-	2,961.36	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688076	诺泰生物	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688328	深科达	2021年3月1日	2021年9月9日	新股流通受限	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-
688355	明志科技	2021年4月30日	2021年11月12日	新股流通受限	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-
688383	新益昌	2021年4月21日	2021年10月28日	新股流通受限	19.58	106.24	2,701	52,885.58	286,954.24	-
688456	有研粉材	2021年3月10日	2021年9月17日	新股流通受限	10.62	26.50	3,396	36,065.52	89,994.00	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688565	力源科技	2021年5月6日	2021年11月15日	新股流通受限	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-

688597	煜邦电力	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	5.88	10.16	3,907	22,973.16	39,695.12	-
688611	杭州柯林	2021年4月1日	2021年10月12日	新股流通受限	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00	-
688619	罗普特	2021年2月8日	2021年8月23日	新股流通受限	19.31	26.74	5,856	113,079.36	156,589.44	-
688685	迈信林	2021年4月30日	2021年11月15日	新股流通受限	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-
688700	东威科技	2021年6月7日	2021年12月15日	新股流通受限	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021年6月16日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	2,240	224,000.00	224,000.00	-

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

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	5,500	196,879.00	309,925.00	-

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金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 9,999,865.00 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
200216	20 国开 16	2021 年 7 月 1 日	100.17	106,000	10,618,020.00

合计				106,000	10,618,020.00
----	--	--	--	---------	---------------

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 40,600,000 元，于 2021 年 7 月 2 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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 80.45%（上年末：89.21%）。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,529,436.93	-	-	-	-	-	2,529,436.93
结算备付金	527,718.59	-	-	-	-	-	527,718.59
存出保证金	104,230.93	-	-	-	-	-	104,230.93
交易性金融资产	7,000,000.00	60,305,000.00	85,543,535.00	434,512,000.00	72,099,592.72	125,206,067.86	784,666,195.58
买入返售金融资产	20,995,210.50	-	-	-	-	-	20,995,210.50
应收利息	-	-	-	-	-	9,868,963.18	9,868,963.18
应收申购款	-	-	-	-	-	999.00	999.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	461,057.66	461,057.66
资产总计	31,156,596.95	60,305,000.00	85,543,535.00	434,512,000.00	72,099,592.72	135,537,087.70	819,153,812.37
负债							

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	353,335.57	353,335.57
应付托管费	-	-	-	-	-	58,889.28	58,889.28
应付证券清算款	-	-	-	-	-	528,142.03	528,142.03
卖出回购金融资产款	50,599,865.00	-	-	-	-	-	50,599,865.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	83,168.05	83,168.05
应付利息	-	-	-	-	-	1,650.50	1,650.50
应交税费	-	-	-	-	-	56,203.20	56,203.20
其他负债	-	-	-	-	-	95,780.45	95,780.45
负债总计	50,599,865.00	-	-	-	-	1,177,169.08	51,777,034.08
利率敏感度缺口	-19,443,268.05	60,305,000.00	85,543,535.00	434,512,000.00	72,099,592.72	-	-
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,462,771.18	-	-	-	-	-	1,462,771.18
结算备付金	662,748.31	-	-	-	-	-	662,748.31
存出保证金	129,790.51	-	-	-	-	-	129,790.51
交易性金融资产	40,083,000.00	40,046,000.00	210,623,000.00	364,129,527.70	874,351.18	127,882,648.71	783,638,527.59
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	-	-	10,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	10,322,486.52	10,322,486.52
应收证券清算款	-	-	-	-	-	648,281.32	648,281.32
资产总计	52,338,310.00	40,046,000.00	210,623,000.00	364,129,527.70	874,351.18	138,853,416.55	806,864,605.43
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	345,693.45	345,693.45
应付托管费	-	-	-	-	-	57,615.58	57,615.58
卖出回购金融资产款	116,151,425.77	-	-	-	-	-	116,151,425.77
应付交易费用	-	-	-	-	-	67,812.92	67,812.92
应付利息	-	-	-	-	-	48,698.28	48,698.28
应交税费	-	-	-	-	-	50,349.76	50,349.76
其他负债	-	-	-	-	-	64,000.00	64,000.00
负债总计	116,151,425.77	-	-	-	-	634,169.99	116,785,595.76
利率敏感度缺口	-63,813,115.77	40,046,000.00	210,623,000.00	364,129,527.70	874,351.18	-	-

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）	

分析	市场利率上升 25 个基点	-2,329,758.28	-1,725,377.73
	市场利率下降 25 个基点	2,344,156.35	1,735,377.52

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	125,206,067.86	16.32	127,882,648.71	18.53
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	125,206,067.86	16.32	127,882,648.71	18.53

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）	

分析	沪深 300 指数上升 5%	5,936,950.98	6,816,129.50
	沪深 300 指数下降 5%	-5,936,950.98	-6,816,129.50

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 2. 其他事项

###### (1) 公允价值

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

###### 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 123,989,082.81 元，划分为第二层次的余额为人民币 660,677,112.77 元，无划分为第三层次的余额（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 124,041,764.68 元，划分为第二层次的余额为人民币 659,596,762.91 元，无划分为第三层次的余额）。

###### 公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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

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

###### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 3. 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 8 月 19 日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	125,206,067.86	15.28
	其中：股票	125,206,067.86	15.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	659,460,127.72	80.51
	其中：债券	659,460,127.72	80.51
	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	20,995,210.50	2.56
	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	3,057,155.52	0.37
8	其他各项资产	10,435,250.77	1.27
9	合计	819,153,812.37	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,273,093.72	0.56
C	制造业	67,434,718.28	8.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,988,276.39	0.39
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	1,706,006.24	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	8,337,028.96	1.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,588,420.40	0.21
J	金融业	35,227,659.10	4.59
K	房地产业	839,188.00	0.11
L	租赁和商务服务业	1,744,956.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	538,669.60	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	48,787.73	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	169,209.00	0.02

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	299,040.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	125,206,067.86	16.32

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002142	宁波银行	252,700	9,847,719.00	1.28
2	600036	招商银行	121,300	6,573,247.00	0.86
3	000001	平安银行	235,500	5,327,010.00	0.69
4	600519	贵州茅台	2,100	4,319,070.00	0.56
5	000333	美的集团	58,500	4,175,145.00	0.54
6	002311	海大集团	50,200	4,096,320.00	0.53
7	000858	五粮液	13,000	3,872,570.00	0.50
8	600900	长江电力	144,150	2,975,256.00	0.39
9	600377	宁沪高速	302,446	2,951,872.96	0.38
10	600887	伊利股份	71,400	2,629,662.00	0.34
11	000568	泸州老窖	10,900	2,571,746.00	0.34
12	601939	建设银行	386,200	2,568,230.00	0.33
13	600741	华域汽车	96,100	2,524,547.00	0.33
14	601318	中国平安	35,700	2,294,796.00	0.30
15	600276	恒瑞医药	31,320	2,128,820.40	0.28
16	601398	工商银行	405,000	2,093,850.00	0.27
17	300760	迈瑞医疗	4,300	2,064,215.00	0.27
18	001965	招商公路	278,300	2,009,326.00	0.26
19	603806	福斯特	18,500	1,944,905.00	0.25
20	601166	兴业银行	94,300	1,937,865.00	0.25
21	601899	紫金矿业	182,200	1,765,518.00	0.23
22	000581	威孚高科	83,300	1,735,139.00	0.23
23	002507	涪陵榨菜	43,200	1,626,912.00	0.21
24	601888	中国中免	5,200	1,560,520.00	0.20
25	300207	欣旺达	47,900	1,559,624.00	0.20
26	601021	春秋航空	27,100	1,541,990.00	0.20
27	600585	海螺水泥	36,800	1,510,640.00	0.20
28	002727	一心堂	45,100	1,493,261.00	0.19
29	601088	中国神华	76,436	1,492,030.72	0.19
30	601688	华泰证券	87,600	1,384,080.00	0.18

31	300568	星源材质	30,231	1,250,656.47	0.16
32	601225	陕西煤业	85,700	1,015,545.00	0.13
33	603816	顾家家居	13,000	1,004,640.00	0.13
34	601233	桐昆股份	41,700	1,004,553.00	0.13
35	000089	深圳机场	128,200	996,114.00	0.13
36	603601	再升科技	85,400	988,078.00	0.13
37	000651	格力电器	18,200	948,220.00	0.12
38	600570	恒生电子	10,090	940,892.50	0.12
39	002966	苏州银行	126,700	931,245.00	0.12
40	000789	万年青	80,800	924,352.00	0.12
41	600048	保利地产	69,700	839,188.00	0.11
42	601636	旗滨集团	44,300	822,208.00	0.11
43	600176	中国巨石	51,452	798,020.52	0.10
44	300014	亿纬锂能	7,600	789,868.00	0.10
45	300750	宁德时代	1,400	748,720.00	0.10
46	601818	光大银行	197,000	744,660.00	0.10
47	603899	晨光文具	8,700	735,672.00	0.10
48	601601	中国太保	23,800	689,486.00	0.09
49	600690	海尔智家	26,100	676,251.00	0.09
50	002643	万润股份	37,500	666,750.00	0.09
51	300630	普利制药	12,100	634,040.00	0.08
52	000429	粤高速A	87,400	626,658.00	0.08
53	002415	海康威视	9,500	612,750.00	0.08
54	002236	大华股份	28,900	609,790.00	0.08
55	002841	视源股份	4,700	584,163.00	0.08
56	300395	菲利华	12,000	578,640.00	0.08
57	000625	长安汽车	21,800	572,904.00	0.07
58	603730	岱美股份	31,250	569,375.00	0.07
59	603920	世运电路	39,520	554,465.60	0.07
60	600926	杭州银行	37,200	548,700.00	0.07
61	000933	神火股份	57,500	543,375.00	0.07
62	603259	药明康德	3,440	538,669.60	0.07
63	300258	精锻科技	39,100	522,767.00	0.07
64	002572	索菲亚	21,500	520,300.00	0.07
65	002906	华阳集团	16,400	517,912.00	0.07
66	002918	蒙娜丽莎	16,400	514,796.00	0.07
67	000596	古井贡酒	2,100	502,950.00	0.07
68	300482	万孚生物	7,500	485,175.00	0.06
69	300737	科顺股份	15,400	484,176.00	0.06
70	300832	新产业	7,800	480,480.00	0.06
71	002475	立讯精密	10,300	473,800.00	0.06
72	300601	康泰生物	3,100	461,900.00	0.06

73	002555	三七互娱	19,100	458,782.00	0.06
74	603833	欧派家居	3,200	454,272.00	0.06
75	603337	杰克股份	16,400	438,372.00	0.06
76	002831	裕同科技	14,300	424,567.00	0.06
77	603583	捷昌驱动	8,120	411,034.40	0.05
78	002049	紫光国微	2,600	400,894.00	0.05
79	000725	京东方 A	62,600	390,624.00	0.05
80	002466	天齐锂业	5,900	365,918.00	0.05
81	600060	海信视像	19,800	334,620.00	0.04
82	002007	华兰生物	8,800	322,784.00	0.04
83	603688	石英股份	13,600	319,600.00	0.04
84	300054	鼎龙股份	17,000	310,250.00	0.04
85	600460	士兰微	5,500	309,925.00	0.04
86	600456	宝钛股份	7,100	304,590.00	0.04
87	300144	宋城演艺	17,800	299,040.00	0.04
88	688383	新益昌	2,701	286,954.24	0.04
89	000733	振华科技	4,600	280,922.00	0.04
90	300037	新宙邦	2,600	260,260.00	0.03
91	600919	江苏银行	35,500	252,050.00	0.03
92	601799	星宇股份	1,100	248,292.00	0.03
93	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.03
94	000830	鲁西化工	12,300	230,379.00	0.03
95	002032	苏泊尔	3,400	216,886.00	0.03
96	000301	东方盛虹	10,200	213,180.00	0.03
97	002120	韵达股份	15,600	211,068.00	0.03
98	603010	万盛股份	10,000	209,700.00	0.03
99	600161	天坛生物	6,100	208,925.00	0.03
100	002556	辉隆股份	18,400	199,640.00	0.03
101	600104	上汽集团	9,000	197,730.00	0.03
102	002497	雅化集团	8,600	195,908.00	0.03
103	000860	顺鑫农业	4,600	194,028.00	0.03
104	002271	东方雨虹	3,400	188,088.00	0.02
105	002027	分众传媒	19,600	184,436.00	0.02
106	002607	中公教育	8,100	169,209.00	0.02
107	688619	罗普特	5,856	156,589.44	0.02
108	603786	科博达	1,600	120,800.00	0.02
109	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.02
110	603517	绝味食品	1,300	109,577.00	0.01
111	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
112	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.01
113	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
114	002078	太阳纸业	6,000	80,100.00	0.01

115	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.01
116	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.01
117	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.01
118	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
119	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.01
120	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.01
121	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
122	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.00
123	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
124	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
125	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
126	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
127	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
128	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
129	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
130	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
131	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
132	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
133	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
134	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
135	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
136	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
137	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
138	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002142	宁波银行	8,587,166.00	1.24
2	000001	平安银行	5,058,825.00	0.73
3	000858	五粮液	2,863,706.00	0.41
4	000333	美的集团	2,689,664.00	0.39
5	002311	海大集团	2,341,318.00	0.34
6	300207	欣旺达	2,182,556.00	0.32
7	001965	招商公路	2,148,698.00	0.31
8	000581	威孚高科	1,862,135.00	0.27
9	002727	一心堂	1,791,129.00	0.26
10	601166	兴业银行	1,658,466.00	0.24
11	600036	招商银行	1,573,753.00	0.23
12	000568	泸州老窖	1,569,009.00	0.23
13	603816	顾家家居	1,239,338.00	0.18

14	600674	川投能源	1,145,586.00	0.17
15	002507	涪陵榨菜	1,126,089.00	0.16
16	000089	深圳机场	1,027,346.00	0.15
17	000651	格力电器	1,015,553.00	0.15
18	000789	万年青	1,007,972.00	0.15
19	603806	福斯特	1,000,787.29	0.15
20	600460	士兰微	990,703.00	0.14

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	7,030,089.40	1.02
2	002142	宁波银行	5,713,467.00	0.83
3	002311	海大集团	3,309,556.00	0.48
4	000568	泸州老窖	2,496,121.00	0.36
5	000725	京东方 A	2,067,736.00	0.30
6	002233	塔牌集团	1,925,776.00	0.28
7	000001	平安银行	1,909,520.00	0.28
8	000858	五粮液	1,902,710.00	0.28
9	600309	万华化学	1,835,960.00	0.27
10	300580	贝斯特	1,576,171.00	0.23
11	600377	宁沪高速	1,547,571.00	0.22
12	601888	中国中免	1,494,331.53	0.22
13	002304	洋河股份	1,347,416.00	0.20
14	002241	歌尔股份	1,346,197.56	0.20
15	002507	涪陵榨菜	1,332,842.00	0.19
16	002475	立讯精密	1,325,194.80	0.19
17	300207	欣旺达	1,292,581.00	0.19
18	002928	华夏航空	1,274,590.37	0.18
19	600176	中国巨石	1,257,566.00	0.18
20	601318	中国平安	1,248,948.00	0.18

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	95,502,670.34
卖出股票收入（成交）总额	108,750,650.69

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	12,053,535.00	1.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,028,000.00	6.52
	其中：政策性金融债	30,040,000.00	3.91
4	企业债券	209,777,000.00	27.34
5	企业短期融资券	30,160,000.00	3.93
6	中期票据	305,226,000.00	39.78
7	可转债（可交换债）	912,592.72	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	51,303,000.00	6.69
10	合计	659,460,127.72	85.94

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	101900022	19 泸州窖 MTN001	300,000	30,231,000.00	3.94
2	163246	20 上国投	300,000	29,931,000.00	3.90
3	101764046	17 张家公资 MTN001	200,000	20,666,000.00	2.69
4	101760064	17 滁州城投 MTN002	200,000	20,648,000.00	2.69
5	101758042	17 武汉地产 MTN002	200,000	20,614,000.00	2.69

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

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

和技术指标等因素。

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

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

1、招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，股票代码：600036）于 2021 年 5 月 17 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（2021）16 号）。其因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品、理财产品之间风险隔离不到位等二十七项违法违规事实，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，被处以罚款 7170 万元。

招商银行于 2020 年 7 月 28 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书（沪银保监银罚决字（2020）7 号）。其信用卡中心因某客户个人信息未尽安全保护义务、对部分信用卡催收外包管理严重不审慎，被处以 100 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招商银行进行了投资。

2、宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”，股票代码：002142）于 2020 年 10 月 16 日收到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局出具的行政处罚决定书（甬银保监罚决字（2020）

48 号)。其因授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位等问题,违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条的规定,被处以罚款人民币 30 万元。

2021 年 6 月 10 日,宁波银行因代理销售保险不规范,违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项、第四十八条第(一)项的相关规定,收到宁波银保监局出具的行政处罚决定书(甬银保监罚决字(2021)36 号),被处以罚款人民币 25 万元,并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

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宁波银行进行了投资。

3、平安银行于 2020 年 10 月 16 日收到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局出具的行政处罚决定书(甬银保监罚决字(2020)66 号)。其因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等问题,违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条的规定,被处以 100 万元罚款。

2021 年 5 月 28 日,平安银行收到中国银保监会云南监管局出具的行政处罚决定书(云银保监罚决字(2021)34 号),其因利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款,用于承接处置本行其他贷款风险等违法违规事实,违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项相关规定,被处以罚款人民币 210 万元。

2021 年 5 月 10 日,平安银行资金运营中心收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书(沪银保监罚决字(2021)55 号),其因违规向未取得土地使用权证的房地产项目提供融资等违法违规事实,违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项相关规定,被处以罚款人民币 300 万元。

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平安银行进行了投资。

4、其余七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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	104,230.93
2	应收证券清算款	461,057.66

3	应收股利	-
4	应收利息	9,868,963.18
5	应收申购款	999.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,435,250.77

#### 7.12.4 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	123075	贝斯转债	139,084.18	0.02
2	113611	福 20 转债	27,534.40	0.00

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
295	2,322,121.15	684,521,271.68	99.93	504,467.68	0.07

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	90,004.55	0.013139

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 3 月 18 日） 基金份额总额	219,826,093.26
本报告期期初基金份额总额	635,657,446.53
本报告期基金总申购份额	521,116,862.24
减：本报告期基金总赎回份额	471,748,569.41
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	685,025,739.36

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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

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

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国国际金融股份有限公司	2	196,969,989.53	100.00%	183,435.91	100.00%	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期新增 2 个

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

## 1) 选择标准

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

## 2) 选择程序

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

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额

				比例		的比例
中国国际金融股份有限公司	181,562,351.08	100.00%	1,271,866,000.00	100.00%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-08
2	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
3	景顺长城基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统招行直联渠道基金交易费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-20
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
5	景顺长城泰申回报混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
6	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-05
7	景顺长城基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-09
8	关于景顺长城旗下部分基金新增好买基金为销售机构并开通基金转换业务及参加申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-24
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-25
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
11	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-20
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-26
13	关于景顺长城泰申回报混合型证券投资基金新增天天基金等公司为销售机构并开通基金转换业务及参加申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
15	景顺长城泰申回报混合型证券投资基	中国证监会指定报刊及	2021-03-29

	金 2020 年年度报告	网站	
16	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-30
17	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
18	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-12
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-15
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-19
21	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-20
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
23	景顺长城泰申回报混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-23
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
26	关于旗下部分基金新增腾安基金为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购、赎回费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-14
27	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-20
28	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-04
29	关于景顺长城泰申回报混合型证券投资基金限制接受伍拾万元以上申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-15
30	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-15
31	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
32	景顺长城泰申回报混合型证券投资基金 2021 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
33	景顺长城泰申回报混合型证券投资基金基金合同更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
34	景顺长城泰申回报混合型证券投资基金托管协议更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210101-20210301	228,888,169.93	81,688,343.89	228,888,169.93	81,688,343.89	11.92
	2	20210302-20210303; 20210305-20210318	99,600,597.61	-	35,000,000.00	64,600,597.61	9.43
	3	20210302-20210509	93,869,332.58	-	20,000,000.00	73,869,332.58	10.78
	4	20210302-20210304	89,640,438.25	-	89,640,438.25	-	-
	5	20210531-20210608	-	126,779,914.43	6,000,000.00	120,779,914.43	17.63

#### 产品特有风险

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

#### 1、大额申购风险

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

#### 2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规及本基金基金合同等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，景顺长

城基金管理有限公司决定对本基金的基金合同等法律文件进行修订，新增侧袋机制相关内容。本次修订属于法律法规规定无需召开基金份额持有人大会的事项，修订自 2021 年 6 月 18 日起正式生效。有关详细信息参见本公司于 2021 年 6 月 18 日发布的相关公告。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城泰申回报混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城泰申回报混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城泰申回报混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城泰申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。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2021 年 8 月 23 日