

景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 23 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

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	51
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	51
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	51
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	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	景顺长城泰恒回报混合	
基金主代码	005325	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 1 月 25 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	462,027,556.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城泰恒回报混合 A 类	景顺长城泰恒回报混合 C 类
下属分级基金的交易代码	005325	005326
报告期末下属分级基金的份额总额	180,594,682.31 份	281,432,874.08 份

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>1、资产配置策略</p> <p>本基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况，在权益类资产、固定收益类资产和现金类资产三大类资产类别间进行相对灵活的配置，资产配置组合主要以债券等固定收益类资产配置为主，并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例，使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上优化投资组合。</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、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> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金参与股指期货交易，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。</p>
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，属于中高预期收益和风险水平的投资品种，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。

	金。
--	----

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳	李申
	联系电话	0755-82370388	021-60637102
	电子邮箱	investor@igwfm.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008888606	021-60637111
传真		0755-22381339	021-60635778
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		李进	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	景顺长城泰恒回报混合 A 类	景顺长城泰恒回报混合 C 类
本期已实现收益	22,658,168.70	15,555,167.81
本期利润	22,030,385.38	12,733,917.02
加权平均基金份额本期利润	0.0766	0.0685
本期加权平均净	5.04%	4.52%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	4.91%	4.80%
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	99,643,369.95	151,772,403.29
期末可供分配基金份额利润	0.5518	0.5393
期末基金资产净值	281,163,356.78	434,626,458.36
期末基金份额净值	1.5568	1.5443
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	55.68%	54.43%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城泰恒回报混合 A 类

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.45%	0.18%	-0.47%	0.25%	0.92%	-0.07%

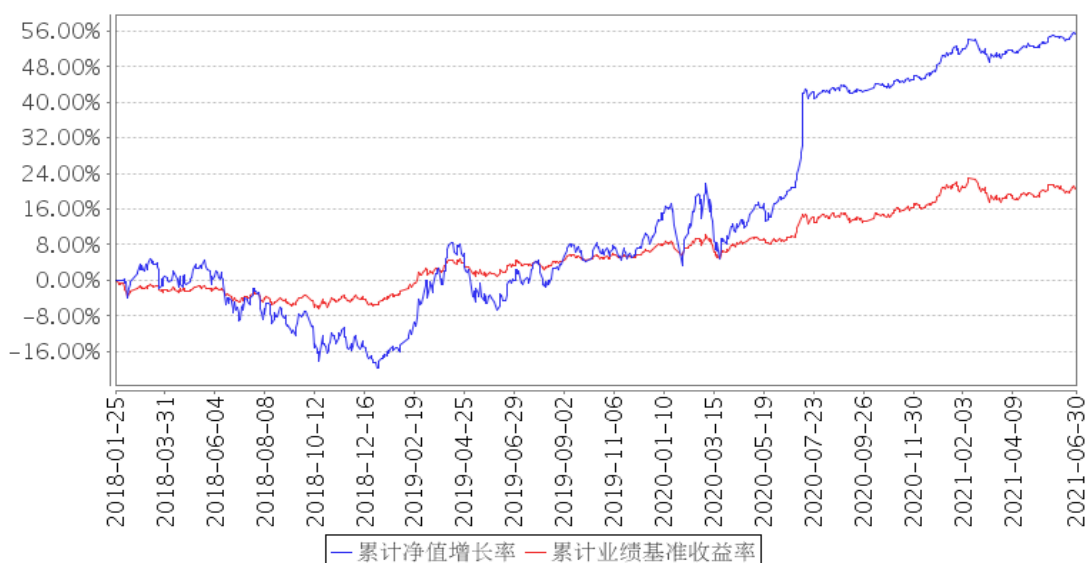
过去三个月	3.09%	0.20%	1.96%	0.30%	1.13%	-0.10%
过去六个月	4.91%	0.31%	1.82%	0.40%	3.09%	-0.09%
过去一年	27.59%	0.66%	9.66%	0.40%	17.93%	0.26%
过去三年	63.84%	1.14%	25.67%	0.40%	38.17%	0.74%
自基金合同生效起 至今	55.68%	1.14%	20.88%	0.40%	34.80%	0.74%

景顺长城泰恒回报混合 C 类

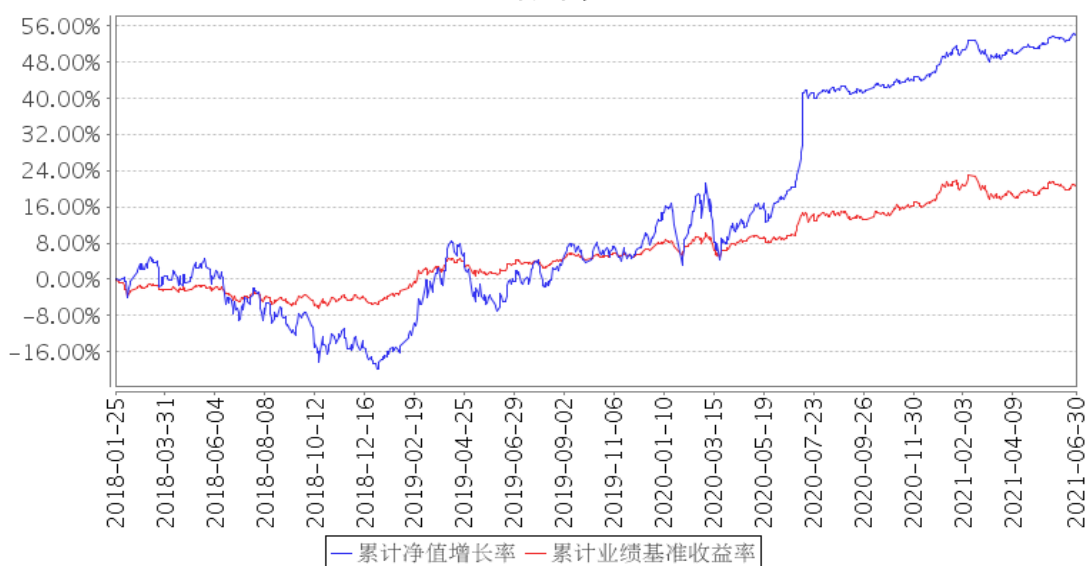
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准 收益率标准 差④	①—③	②—④
过去一个月	0.44%	0.18%	-0.47%	0.25%	0.91%	-0.07%
过去三个月	3.04%	0.20%	1.96%	0.30%	1.08%	-0.10%
过去六个月	4.80%	0.31%	1.82%	0.40%	2.98%	-0.09%
过去一年	27.13%	0.66%	9.66%	0.40%	17.47%	0.26%
过去三年	62.63%	1.13%	25.67%	0.40%	36.96%	0.73%
自基金合同生效起 至今	54.43%	1.14%	20.88%	0.40%	33.55%	0.74%

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

景顺长城泰恒回报混合A类累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城泰恒回报混合C类累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2018 年 1 月 25 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2021年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理124只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金（QDII）、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小创精选股票型证券投资基金、景顺长城中证科技传媒通信150交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证科技传媒通信150交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型

证券投资基金、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化小盘股票型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金、景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景泰鑫利纯债债券型证券投资基金、景顺长城智能生活混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金、景顺长城集英成长两年定期开放混合型证券投资基金、景顺长城量化港股通股票型证券投资基金、景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金、景顺长城绩优成长混合型证券投资基金、景顺长城中短债债券型证券投资基金、景顺长城中证沪港深红利成长低波动指数型证券投资基金、景顺长城稳健养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城创新成长混合型证券投资基金、景顺长城景泰纯利债券型证券投资基金、景顺长城养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城弘利 39 个月定期开放债券型证券投资基金、景顺长城品质成长混合型证券投资基金、景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、景顺长城泰申回报混合型证券投资基金、景顺长城科技创新混合型证券投资基金、景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金、景顺长城景泰裕利纯债债券型证券投资基金、景顺长城核心优选一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城创业板综指增强型证券投资基金、景顺长城成长领航混合型证券投资基金、景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城安鑫回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城弘远 66 个月定期开放债券型证券投资基金、景顺长城价值稳进三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城竞争优势混合型证券投资基金、景顺长城景泰添利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、景顺长城价值边际灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城电子信息产业股票型证券投资基金、景顺长城消费精选混合型证券投资基金、景顺长城景颐招利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城顺鑫回报混合型证券投资基金、景顺长城

景泰宝利一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金、景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金、景顺长城核心中景一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、景顺长城核心招景混合型证券投资基金、景顺长城景泰恒利一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城产业趋势混合型证券投资基金、景顺长城景泰益利纯债债券型证券投资基金、景顺长城成长龙头一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城品质长青混合型证券投资基金、景顺长城新能源产业股票型证券投资基金、景顺长城安泽回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城泰源回报混合型证券投资基金、景顺长城景骊成长混合型证券投资基金、景顺长城安盈回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城景气成长混合型证券投资基金、景顺长城安益回报一年持有期混合型证券投资基金、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		
徐喻军	本基金的基金经理	2018年3月6日	-	11年	理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012年3月加入本公司，担任量化及ETF投资部ETF专员，自2014年4月起担任量化及指数投资部基金经理。具有11年证券、基金行业从业经验。
陈健宾	本基金的基金经理	2021年2月27日	-	5年	金融硕士。曾任泰康资产管理有限责任公司信用研究部信用评估研究高级经理。2019年4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2021年2月起担任固定收益部基金经理。具有5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；

3、陈健宾先生于2020年11月3日至2021年2月26日担任景顺长城睿成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基金经理助理。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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

2021 年上半年，随着发达国家疫苗接种的持续推进，全球疫情逐步得到有效控制，在美国政府新一轮刺激计划的带动下，海外需求继续快速修复，大宗商品价格出现大幅上涨。6 月国内工业增加值累计同比上涨 15.9%，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 51.1、51.0、50.9，经济扩张动能边际减弱。6 月 PPI 同比上涨 8.8%，环比上涨 0.3%；CPI 同比上涨 1.1%，环比下跌 0.4%，PPI 同比高点已现，通胀预期有所缓和。6 月 M2 同比增速 8.6%，M1 同比增速 5.5%，国内货币政策总体保持稳健，流动性合理适度，宏观环境总体温和。6 月社融增速 11%，信贷社融数据保持稳定。6 月末外汇储备 3.2 万亿美元，汇率维持平稳。上半年 A 股权益市场出现大幅波动，一季度美债收益率的快速抬升使得核心资产出现连续下跌，二季度市场风险偏好有所提升，景气度较高的成

长板块表现突出，综合来看，上半年上证指数上涨 3.4%，沪深 300 上涨 0.24%，而以医药和科技为代表的创业板指表现强势，上涨 17.22%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年上半年，泰恒回报混合 A 份额净值增长率为 4.91%，业绩比较基准收益率为 1.82%。

2021 年上半年，泰恒回报混合 C 份额净值增长率为 4.80%，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 2021 年下半年，上半年韧性较高的地产投资和景气程度较强的出口在下半年均有回落风险，经济扩张动能减弱的趋势或维持，我们对宏观场景的判断仍然是“稳货币、紧信用”。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。权益市场仍具备结构性配置机会，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

债券方面，上半年以来，利率债收益率整体震荡下行。受益于二月后相对宽松的资金面以及环比走弱的经济基本面推动，相较于 20 年末，中债 10 年期国债估值下行 7BP 至 3.08%，10 年期国开下行 4BP 至 3.49%。组合主要目前以持有中高等级信用债及利率债为主。今年二季度以来信用风险事件明显减少，市场对违约风险担忧有所缓和，但弱资质主体再融资仍相对困难，为避免信用风险，组合仍以利率债及中高等级信用债为主，以获取稳定票息收益，同时在货币市场资金面相对偏松背景下，适当利用杠杆策略增厚收益。

组合操作计划上，组合仍计划以中高等级信用债与利率债为主，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。另一方面，关注下半年出口数据的边际变化以及央行货币政策情况，若收益率出现明显调整，则考虑适当拉长久期，增厚组合收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城泰恒回报灵活配置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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,806,636.52	21,564,303.56
结算备付金		353,078.50	601,328.15
存出保证金		33,860.55	108,855.48
交易性金融资产	6.4.7.2	854,711,812.54	748,711,672.76
其中：股票投资		141,004,612.54	166,046,772.76
基金投资		-	-
债券投资		713,707,200.00	582,664,900.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	12,000,126.00	-
应收证券清算款		2,303,921.81	801,114.87
应收利息	6.4.7.5	7,272,422.67	7,438,045.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	999.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		882,481,858.59	779,226,320.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		164,000,000.00	75,019,687.47
应付证券清算款		1,640,576.04	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		453,924.95	493,267.62
应付托管费		56,740.63	61,658.48
应付销售服务费		69,320.97	31,649.43
应付交易费用	6.4.7.7	330,482.01	241,985.74
应交税费		37,779.30	41,214.62
应付利息		-	27,881.07

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	103,219.55	199,000.00
负债合计		166,692,043.45	76,116,344.43
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	462,027,556.39	474,705,623.17
未分配利润	6.4.7.10	253,762,258.75	228,404,352.75
所有者权益合计		715,789,815.14	703,109,975.92
负债和所有者权益总计		882,481,858.59	779,226,320.35

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 462,027,556.39 份，景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 1.5568 元，份额总额 180,594,682.31 份；景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额净值人民币 1.5443 元，份额总额 281,432,874.08 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城泰恒回报灵活配置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 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		40,210,562.09	16,211,541.15
1. 利息收入		9,709,913.24	150,831.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	25,967.78	68,534.67
债券利息收入		9,586,137.49	20,315.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		97,807.97	61,981.65
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		33,873,099.92	23,734,784.06
其中：股票投资收益	6.4.7.12	32,539,670.13	22,433,946.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-33,941.07	1,800.86
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	1,367,370.86	1,299,036.49

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-3,449,034.11	-7,674,134.31
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	76,583.04	59.73
减：二、费用		5,446,259.69	1,791,527.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,855,610.09	705,709.08
2. 托管费	6.4.10.2.2	356,951.26	88,213.59
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	278,649.33	1,265.14
4. 交易费用	6.4.7.18	898,017.24	911,962.95
5. 利息支出		896,478.64	-
其中：卖出回购金融资产支出		896,478.64	-
6. 税金及附加		30,698.22	44.84
7. 其他费用	6.4.7.19	129,854.91	84,332.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,764,302.40	14,420,013.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,764,302.40	14,420,013.18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城泰恒回报灵活配置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）	474,705,623.17	228,404,352.75	703,109,975.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,764,302.40	34,764,302.40
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）	-12,678,066.78	-9,406,396.40	-22,084,463.18
其中：1. 基金申购款	272,363,578.45	141,837,980.75	414,201,559.20
2. 基金赎回	-285,041,645.23	-151,244,377.15	-436,286,022.38

回款			
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）	462,027,556.39	253,762,258.75	715,789,815.14
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	160,337,213.33	18,883,395.91	179,220,609.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,420,013.18	14,420,013.18
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）	-72,397,046.39	-13,974,311.74	-86,371,358.13
其中：1. 基金申购款	7,727,786.81	1,309,469.67	9,037,256.48
2. 基金赎回款	-80,124,833.20	-15,283,781.41	-95,408,614.61
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）	87,940,166.94	19,329,097.35	107,269,264.29

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

景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1947 号文《关于准予景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》作为发起人于 2018 年 1 月 16 日至 2018 年 1 月 22 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（2018）验字第 60467014_H01 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 2018 年 1 月 25 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 339,419,558.82 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 55,084.13 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 339,474,642.95 元，折合 339,474,642.95 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。A 类基金份额类别为在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用，且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额；C 类基金份额为从本类别基金资产净值中计提销售服务费，但不收取认购/申购费用的基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

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	5,806,636.52

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	5,806,636.52

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	131,305,554.21	141,004,612.54	9,699,058.33
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	250,652,813.97	250,607,200.00
	银行间市场	461,619,310.45	463,100,000.00
	合计	712,272,124.42	713,707,200.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	843,577,678.63	854,711,812.54	11,134,133.91

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	12,000,126.00	-
合计	12,000,126.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,559.56
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	143.01
应收债券利息	7,268,859.73
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,846.60
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	13.77
合计	7,272,422.67

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	309,699.64
银行间市场应付交易费用	20,782.37
合计	330,482.01

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	103,219.55
合计	103,219.55

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城泰恒回报混合 A 类

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	345,541,878.41	345,541,878.41
本期申购	55,671,869.07	55,671,869.07
本期赎回（以“-”号填列）	-220,619,065.17	-220,619,065.17
-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	180,594,682.31	180,594,682.31

景顺长城泰恒回报混合 C 类

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	129,163,744.76	129,163,744.76
本期申购	216,691,709.38	216,691,709.38
本期赎回（以“-”号填列）	-64,422,580.06	-64,422,580.06
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	281,432,874.08	281,432,874.08

注：本报告期申购份额包含基金转入份额；本报告期赎回份额包含基金转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城泰恒回报混合 A 类

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	161,882,588.83	5,357,423.89	167,240,012.72
本期利润	22,658,168.70	-627,783.32	22,030,385.38
本期基金份额交易产生的变动数	-84,897,387.58	-3,804,336.05	-88,701,723.63
其中：基金申购款	29,110,611.46	216,043.67	29,326,655.13
基金赎回款	-114,007,999.04	-4,020,379.72	-118,028,378.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	99,643,369.95	925,304.52	100,568,674.47

景顺长城泰恒回报混合 C 类

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	59,174,668.48	1,989,671.55	61,164,340.03
本期利润	15,555,167.81	-2,821,250.79	12,733,917.02
本期基金份额交易产生的变动数	77,042,567.00	2,252,760.23	79,295,327.23
其中：基金申	107,611,773.68	4,899,551.94	112,511,325.62

购款			
基金赎回款	-30,569,206.68	-2,646,791.71	-33,215,998.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	151,772,403.29	1,421,180.99	153,193,584.28

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	20,753.86
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	4,892.56
其他	321.36
合计	25,967.78

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	299,707,971.01
减：卖出股票成本总额	267,168,300.88
买卖股票差价收入	32,539,670.13

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	1,010,575,334.07
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	995,978,191.98
减：应收利息总额	14,631,083.16
买卖债券差价收入	-33,941.07

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	1,367,370.86
其中：证券出借权益补偿收	-

入	
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,367,370.86

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	-3,449,034.11
股票投资	-5,914,198.71
债券投资	2,465,164.60
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	-3,449,034.11

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	76,583.04
合计	76,583.04

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	881,517.24
银行间市场交易费用	16,500.00
合计	898,017.24

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	34,712.18
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	16,675.36

其他	360.00
合计	129,854.91

6.4.7.20 分部报告

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	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	20,064,980.08	3.73	563,263.64	0.10

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	18,687.71	3.73	18,687.71	6.03
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	524.55	0.10	524.55	0.14

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,855,610.09
其中：支付销售机构的客户维护费	50,638.74	-

注：基金管理费每日计提，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0.80%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	356,951.26

注：基金托管费每日计提，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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城泰恒回报混合 A 类	景顺长城泰恒回报混合 C 类	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	157,074.98	157,074.98
合计	-	157,074.98	157,074.98
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城泰恒回报混合 A 类	景顺长城泰恒回报混合 C 类	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	1,183.81	1,183.81
合计	-	1,183.81	1,183.81

注：基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期	5,806,636.52	20,753.86	31,684,077.73	66,423.21

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内均未参与关联方承销的证券投资。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股流通受限	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021年6月4日	2021年8月25日	新股流通受限	-	27.42	108	-	2,961.36	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-

		日	日								
300956	英力股份	2021年 3月16 日	2021年 9月27 日	新股流 通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80		-
300957	贝泰妮	2021年 3月18 日	2021年 9月27 日	新股流 通受限	47.33	251.96	578	27,356.74	145,632.88		-
300958	建工修复	2021年 3月18 日	2021年 9月29 日	新股流 通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00		-
300960	通业科技	2021年 3月22 日	2021年 9月29 日	新股流 通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04		-
300961	深水海纳	2021年 3月23 日	2021年 9月30 日	新股流 通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58		-
300962	中金辐照	2021年 3月29 日	2021年 10月 11日	新股流 通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12		-
300966	共同药业	2021年 3月31 日	2021年 10月 11日	新股流 通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44		-
300967	晓鸣股份	2021年 4月2 日	2021年 10月 13日	新股流 通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78		-
300968	格林精密	2021年 4月6 日	2021年 10月 15日	新股流 通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34		-
300971	博亚精工	2021年 4月7 日	2021年 10月 15日	新股流 通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05		-
300973	立高食品	2021年 4月8 日	2021年 10月 15日	新股流 通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60		-
300975	商络电子	2021年 4月14 日	2021年 10月 21日	新股流 通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76		-
300978	东箭科技	2021年 4月15 日	2021年 10月 26日	新股流 通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80		-
300979	华利集团	2021年 4月15 日	2021年 10月 26日	新股流 通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50		-
300981	中红	2021年	2021年	新股流	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39		-

	医疗	4月19日	10月27日	通受限						
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

301011	华立科技	2021年 6月9日	2021年 12月 17日	新股流 通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年 6月15日	2021年 12月 22日	新股流 通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021年 6月22日	2021年 12月 30日	新股流 通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年 6月23日	2021年 12月 30日	新股流 通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301018	申菱环境	2021年 6月28日	2021年 7月7日	新股流 通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021年 6月28日	2022年 1月7日	新股流 通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
605162	新中港	2021年 6月29日	2021年 7月7日	新股流 通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年 6月28日	2021年 7月6日	新股流 通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
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	-
688319	欧林生物	2021年 5月31日	2021年 12月8日	新股流 通受限	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
688329	艾隆科技	2021年 3月16日	2021年 9月29日	新股流 通受限	16.81	50.04	1,846	31,031.26	92,373.84	-
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	-
688533	上声电子	2021年 4月9日	2021年 10月 19日	新股流 通受限	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688575	亚辉龙	2021年 5月10日	2021年 11月	新股流 通受限	14.80	32.09	3,435	50,838.00	110,229.15	-

		日	17 日								
688609	九联科技	2021 年 3 月 15 日	2021 年 9 月 23 日	新股流通受限	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88		-
688613	奥精医疗	2021 年 5 月 13 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50		-
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		-
688636	智明达	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 8 日	新股流通受限	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96		-
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	
123117	健帆转债	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 12 日	新债未上市	100.00	100.00	83	8,300.00	8,300.00		-
127038	国微转债	2021 年 6 月 10 日	2021 年 7 月 14 日	新债未上市	100.00	100.00	129	12,900.00	12,900.00		-

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

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 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 164,000,000.00 元，于 2021 年 7 月 7 日前（含当日）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 84.28%（上年末：77.03%）。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建

立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人通过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	5,806,636.52	-	-	-	-	-	5,806,636.52
结算备付金	353,078.50	-	-	-	-	-	353,078.50
存出保证金	33,860.55	-	-	-	-	-	33,860.55
交易性金融资产	-	-	69,980,000.00	542,135,000.00	101,592,200.00	141,004,612.54	854,711,812.54
买入返售金融资产	12,000,126.00	-	-	-	-	-	12,000,126.00
应收利息	-	-	-	-	-	7,272,422.67	7,272,422.67
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,303,921.81	2,303,921.81
资产总计	18,193,701.57	-	69,980,000.00	542,135,000.00	101,592,200.00	150,580,957.02	882,481,858.59
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	453,924.95	453,924.95
应付托管费	-	-	-	-	-	56,740.63	56,740.63
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,640,576.04	1,640,576.04
卖出回购金融资产款	164,000,000.00	-	-	-	-	-	164,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	69,320.97	69,320.97
应付交易费用	-	-	-	-	-	330,482.01	330,482.01
应交税费	-	-	-	-	-	37,779.30	37,779.30
其他负债	-	-	-	-	-	103,219.55	103,219.55
负债总计	164,000,000.00	-	-	-	-	2,692,043.45	166,692,043.45
利率敏感度缺口	-145,806,298.43	-	69,980,000.00	542,135,000.00	101,592,200.00	-	-
上年度末	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

2020 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	21,564,303.56	-	-	-	-	-	21,564,303.56
结算备付金	601,328.15	-	-	-	-	-	601,328.15
存出保证金	108,855.48	-	-	-	-	-	108,855.48
交易性金融资产	41,063,900.00	80,104,000.00	281,629,000.00	179,862,000.00	6,000.00	166,046,772.76	748,711,672.76
应收利息	-	-	-	-	-	7,438,045.63	7,438,045.63
应收申购款	-	-	-	-	-	999.90	999.90
应收证券清算款	-	-	-	-	-	801,114.87	801,114.87
资产总计	63,338,387.19	80,104,000.00	281,629,000.00	179,862,000.00	6,000.00	174,286,933.16	779,226,320.35
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	493,267.62	493,267.62
应付托管费	-	-	-	-	-	61,658.48	61,658.48
卖出回购金融资产款	75,019,687.47	-	-	-	-	-	75,019,687.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	31,649.43	31,649.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	241,985.74	241,985.74
应付利息	-	-	-	-	-	27,881.07	27,881.07
应交税费	-	-	-	-	-	41,214.62	41,214.62
其他负债	-	-	-	-	-	199,000.00	199,000.00
负债总计	75,019,687.47	-	-	-	-	1,096,656.96	76,116,344.43
利率敏感度缺口	-11,681,300.28	80,104,000.00	281,629,000.00	179,862,000.00	6,000.00	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（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	-4,778,110.98	-1,518,120.95
	市场利率下降 25 个基点	4,826,254.65	1,529,908.86

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	141,004,612.54	19.70	166,046,772.76	23.62
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	141,004,612.54	19.70	166,046,772.76	23.62

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%	7,548,568.84	8,814,443.71
	沪深 300 指数下降 5%	-7,548,568.84	-8,814,443.71

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

2. 其他事项

(1) 公允价值

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

各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的持续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 139,025,205.91 元，划分为第二层次的余额为人民币 715,686,606.63 元，无划分为第三层次的余额。（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的持续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 160,431,156.01 元，划分为第二层次的余额为人民币 588,280,516.75 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	141,004,612.54	15.98
	其中：股票	141,004,612.54	15.98
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	713,707,200.00	80.87
	其中：债券	713,707,200.00	80.87
	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	12,000,126.00	1.36
	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	6,159,715.02	0.70
8	其他各项资产	9,610,205.03	1.09
9	合计	882,481,858.59	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	899,174.94	0.13
B	采矿业	2,146,406.00	0.30
C	制造业	76,879,381.63	10.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,423,973.39	0.34
E	建筑业	2,523,014.37	0.35
F	批发和零售业	930,881.46	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	4,657,331.00	0.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,666,932.53	0.37
J	金融业	32,450,214.89	4.53
K	房地产业	1,317,319.00	0.18
L	租赁和商务服务业	4,470,885.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	2,315,800.76	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	818,886.33	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,117,109.24	0.71
R	文化、体育和娱乐业	1,387,302.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	141,004,612.54	19.70

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	600519	贵州茅台	2,800	5,758,760.00	0.80
2	600036	招商银行	95,000	5,148,050.00	0.72
3	000725	京东方A	814,100	5,079,984.00	0.71
4	601211	国泰君安	270,000	4,627,800.00	0.65
5	000858	五粮液	15,099	4,497,841.11	0.63
6	300059	东方财富	122,976	4,032,383.04	0.56
7	600887	伊利股份	98,900	3,642,487.00	0.51
8	600919	江苏银行	423,800	3,008,980.00	0.42
9	600809	山西汾酒	6,300	2,822,400.00	0.39
10	002142	宁波银行	70,300	2,739,591.00	0.38
11	601919	中远海控	86,000	2,626,440.00	0.37
12	600309	万华化学	22,500	2,448,450.00	0.34
13	000001	平安银行	105,600	2,388,672.00	0.33
14	600132	重庆啤酒	10,153	2,009,786.35	0.28
15	300124	汇川技术	25,200	1,871,352.00	0.26
16	002410	广联达	27,300	1,861,860.00	0.26
17	300015	爱尔眼科	25,283	1,794,587.34	0.25
18	601888	中国中免	5,800	1,740,580.00	0.24
19	601668	中国建筑	373,600	1,737,240.00	0.24
20	603882	金域医学	10,470	1,672,791.90	0.23
21	601318	中国平安	26,000	1,671,280.00	0.23
22	300122	智飞生物	8,900	1,661,897.00	0.23
23	603259	药明康德	10,464	1,638,557.76	0.23
24	601598	中国外运	315,900	1,595,295.00	0.22
25	002027	分众传媒	160,500	1,510,305.00	0.21
26	600741	华域汽车	55,000	1,444,850.00	0.20
27	000100	TCL 科技	185,100	1,416,015.00	0.20
28	601928	凤凰传媒	194,300	1,387,302.00	0.19
29	601336	新华保险	29,200	1,340,572.00	0.19
30	600426	华鲁恒升	42,120	1,303,614.00	0.18
31	002241	歌尔股份	29,000	1,239,460.00	0.17
32	601319	中国人保	208,000	1,233,440.00	0.17
33	300463	迈克生物	29,200	1,229,028.00	0.17
34	002179	中航光电	15,500	1,224,810.00	0.17
35	600057	厦门象屿	195,200	1,220,000.00	0.17
36	601012	隆基股份	13,720	1,218,884.80	0.17
37	000166	申万宏源	248,500	1,162,980.00	0.16

38	600019	宝钢股份	152,100	1,162,044.00	0.16
39	601899	紫金矿业	119,600	1,158,924.00	0.16
40	601838	成都银行	90,300	1,141,392.00	0.16
41	600298	安琪酵母	20,800	1,131,104.00	0.16
42	601166	兴业银行	52,805	1,085,142.75	0.15
43	000898	鞍钢股份	241,800	1,076,010.00	0.15
44	002271	东方雨虹	19,450	1,075,974.00	0.15
45	601636	旗滨集团	56,700	1,052,352.00	0.15
46	000651	格力电器	19,500	1,015,950.00	0.14
47	601377	兴业证券	103,200	996,912.00	0.14
48	002030	达安基因	45,200	960,048.00	0.13
49	603678	火炬电子	14,100	951,750.00	0.13
50	300244	迪安诊断	24,400	934,520.00	0.13
51	600483	福能股份	87,700	919,973.00	0.13
52	300639	凯普生物	27,755	916,192.55	0.13
53	002714	牧原股份	14,688	893,324.16	0.12
54	000656	金科股份	151,400	876,606.00	0.12
55	002382	蓝帆医疗	41,700	869,445.00	0.12
56	603986	兆易创新	4,600	864,340.00	0.12
57	600011	华能国际	198,100	835,982.00	0.12
58	002049	紫光国微	5,200	801,788.00	0.11
59	002064	华峰化学	56,400	800,880.00	0.11
60	603288	海天味业	6,100	786,595.00	0.11
61	000800	一汽解放	71,900	777,958.00	0.11
62	002266	浙富控股	155,200	774,448.00	0.11
63	000661	长春高新	2,000	774,000.00	0.11
64	002415	海康威视	11,600	748,200.00	0.10
65	000528	柳工	87,300	715,860.00	0.10
66	000799	酒鬼酒	2,800	715,680.00	0.10
67	300347	泰格医药	3,700	715,210.00	0.10
68	000825	太钢不锈	95,400	714,546.00	0.10
69	000333	美的集团	9,607	685,651.59	0.10
70	300677	英科医疗	5,400	673,920.00	0.09
71	002097	山河智能	78,200	670,956.00	0.09
72	000425	徐工机械	104,200	663,754.00	0.09
73	300782	卓胜微	1,220	655,750.00	0.09
74	603267	鸿远电子	5,100	652,392.00	0.09
75	000338	潍柴动力	36,300	648,681.00	0.09
76	601898	中煤能源	87,900	628,485.00	0.09
77	000568	泸州老窖	2,500	589,850.00	0.08
78	601328	交通银行	118,400	580,160.00	0.08
79	002311	海大集团	7,100	579,360.00	0.08

80	000830	鲁西化工	30,900	578,757.00	0.08
81	300529	健帆生物	6,700	578,612.00	0.08
82	600502	安徽建工	145,400	564,152.00	0.08
83	300747	锐科激光	4,800	547,488.00	0.08
84	688036	传音控股	2,601	544,909.50	0.08
85	601100	恒立液压	6,200	532,704.00	0.07
86	002966	苏州银行	71,100	522,585.00	0.07
87	300755	华致酒行	12,700	518,287.00	0.07
88	000157	中联重科	54,700	505,428.00	0.07
89	600966	博汇纸业	37,700	491,985.00	0.07
90	000875	吉电股份	84,700	486,178.00	0.07
91	000921	海信家电	33,200	477,084.00	0.07
92	601601	中国太保	16,200	469,314.00	0.07
93	002408	齐翔腾达	35,400	439,668.00	0.06
94	601006	大秦铁路	66,200	435,596.00	0.06
95	603486	科沃斯	1,900	433,352.00	0.06
96	000063	中兴通讯	12,600	418,698.00	0.06
97	000933	神火股份	43,000	406,350.00	0.06
98	002603	以岭药业	13,600	396,576.00	0.06
99	688111	金山办公	999	394,405.20	0.06
100	300759	康龙化成	1,700	368,883.00	0.05
101	002244	滨江集团	83,200	348,608.00	0.05
102	300661	圣邦股份	1,350	341,185.50	0.05
103	601699	潞安环能	28,500	336,585.00	0.05
104	300146	汤臣倍健	10,200	335,580.00	0.05
105	603186	华正新材	8,800	320,848.00	0.04
106	600742	一汽富维	30,300	308,757.00	0.04
107	300676	华大基因	2,600	308,360.00	0.04
108	600176	中国巨石	19,682	305,267.82	0.04
109	603799	华友钴业	2,600	296,920.00	0.04
110	300101	振芯科技	14,900	266,859.00	0.04
111	600901	江苏租赁	51,200	266,240.00	0.04
112	002056	横店东磁	19,700	256,100.00	0.04
113	300327	中颖电子	3,000	255,690.00	0.04
114	300395	菲利华	5,300	255,566.00	0.04
115	300373	扬杰科技	4,200	254,268.00	0.04
116	000012	南玻A	23,700	242,688.00	0.03
117	300642	透景生命	2,600	223,106.00	0.03
118	600111	北方稀土	10,600	219,420.00	0.03
119	600845	宝信软件	4,160	211,744.00	0.03
120	002048	宁波华翔	10,400	202,800.00	0.03
121	600039	四川路桥	31,300	196,251.00	0.03

122	002568	百润股份	2,060	195,267.40	0.03
123	603606	东方电缆	9,600	193,344.00	0.03
124	601607	上海医药	8,800	185,944.00	0.03
125	002043	兔宝宝	18,500	182,410.00	0.03
126	000026	飞亚达	13,000	180,960.00	0.03
127	600031	三一重工	6,000	174,420.00	0.02
128	600023	浙能电力	46,000	168,820.00	0.02
129	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.02
130	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.02
131	002460	赣锋锂业	1,300	157,417.00	0.02
132	688619	罗普特	5,856	156,589.44	0.02
133	600295	鄂尔多斯	8,400	150,276.00	0.02
134	300957	贝泰妮	578	145,632.88	0.02
135	601339	百隆东方	25,900	139,601.00	0.02
136	000550	江铃汽车	5,500	128,865.00	0.02
137	603599	广信股份	4,200	126,336.00	0.02
138	300406	九强生物	5,900	116,407.00	0.02
139	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.02
140	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
141	300408	三环集团	2,300	97,566.00	0.01
142	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.01
143	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.01
144	600606	绿地控股	16,900	92,105.00	0.01
145	603260	合盛硅业	1,100	84,601.00	0.01
146	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
147	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
148	000807	云铝股份	6,700	79,730.00	0.01
149	688636	智明达	918	74,100.96	0.01
150	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.01
151	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
152	600282	南钢股份	16,800	59,808.00	0.01
153	601600	中国铝业	10,800	57,240.00	0.01
154	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.01
155	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
156	300760	迈瑞医疗	100	48,005.00	0.01
157	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
158	002557	洽洽食品	912	39,307.20	0.01
159	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
160	000039	中集集团	1,900	34,542.00	0.00
161	002254	泰和新材	1,400	28,378.00	0.00
162	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
163	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00

164	600489	中金黄金	2,600	22,412.00	0.00
165	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
166	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
167	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
168	002645	华宏科技	1,100	17,578.00	0.00
169	300458	全志科技	200	17,532.00	0.00
170	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
171	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
172	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
173	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
174	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
175	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
176	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
177	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
178	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
179	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
180	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
181	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
182	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
183	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
184	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
185	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
186	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
187	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
188	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
189	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
190	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
191	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
192	600729	重庆百货	300	8,235.00	0.00
193	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
194	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
195	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
196	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
197	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
198	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
199	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
200	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
201	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
202	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
203	002531	天顺风能	700	6,055.00	0.00
204	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
205	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00

206	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
207	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
208	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
209	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
210	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
211	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
212	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
213	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
214	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601229	上海银行	5,907,751.00	0.84
2	002736	国信证券	5,053,200.00	0.72
3	601211	国泰君安	5,010,302.00	0.71
4	600919	江苏银行	4,852,447.60	0.69
5	601328	交通银行	4,433,218.00	0.63
6	002142	宁波银行	3,953,733.00	0.56
7	601377	兴业证券	3,941,807.00	0.56
8	000001	平安银行	3,820,423.00	0.54
9	000725	京东方 A	3,734,852.00	0.53
10	601318	中国平安	3,729,060.00	0.53
11	000858	五粮液	3,433,093.00	0.49
12	600519	贵州茅台	3,432,585.00	0.49
13	600809	山西汾酒	3,013,813.00	0.43
14	000656	金科股份	2,928,067.00	0.42
15	601618	中国中冶	2,701,392.00	0.38
16	000100	TCL 科技	2,645,988.00	0.38
17	000671	阳光城	2,514,975.00	0.36
18	300059	东方财富	2,466,801.00	0.35
19	000069	华侨城 A	2,192,244.00	0.31
20	601668	中国建筑	2,132,853.00	0.30

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	7,123,190.00	1.01
2	000001	平安银行	7,060,292.00	1.00
3	002736	国信证券	6,042,013.00	0.86

4	601229	上海银行	6,036,739.56	0.86
5	600519	贵州茅台	5,846,993.00	0.83
6	601166	兴业银行	5,647,557.00	0.80
7	601377	兴业证券	5,290,210.00	0.75
8	600036	招商银行	5,081,331.00	0.72
9	601211	国泰君安	4,914,721.00	0.70
10	601225	陕西煤业	4,432,632.90	0.63
11	000333	美的集团	4,312,852.70	0.61
12	600900	长江电力	4,076,641.00	0.58
13	601328	交通银行	3,833,599.00	0.55
14	600919	江苏银行	3,291,674.20	0.47
15	000932	华菱钢铁	3,185,834.00	0.45
16	601117	中国化学	3,120,682.10	0.44
17	600031	三一重工	3,113,043.00	0.44
18	300760	迈瑞医疗	3,100,441.00	0.44
19	000858	五粮液	2,772,959.00	0.39
20	300059	东方财富	2,596,502.00	0.37

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	248,040,339.37
卖出股票收入（成交）总额	299,707,971.01

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	130,391,000.00	18.22
	其中：政策性金融债	110,411,000.00	15.43
4	企业债券	250,586,000.00	35.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	261,330,000.00	36.51
7	可转债（可交换债）	21,200.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	71,379,000.00	9.97
10	合计	713,707,200.00	99.71

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	163181	20 东风 01	500,000	49,885,000.00	6.97
2	210206	21 国开 06	400,000	40,004,000.00	5.59
3	2028049	20 工商银行二级 02	300,000	30,537,000.00	4.27
4	111097	20SZMC07	300,000	30,309,000.00	4.23
5	102100611	21 华侨城 MTN001	300,000	30,213,000.00	4.22

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

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

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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、江苏银行股份有限公司（以下简称“江苏银行”，股票代码：600919）于 2020 年 12 月 30 日收到中国银行保险监督管理委员会江苏监管局出具的行政处罚决定书（苏银保监罚决字〔2020〕88 号）。其因个人贷款资金用途管控不严等多项问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项等规定，被处以 240 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江苏银行进行了投资。

4、中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”，股票代码：601398）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〕71号)。其因未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告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、第三十三条、第四十六条和相关审慎经营规则规定,被处以 5470 万元罚款。

工商银行私人银行部于 2021 年 5 月 10 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(沪银保监罚决字〔2021〕54号)。其因部分理财产品交易存在利益输送,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)项的相关规定,被处以 50 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工商银行进行了投资。

5、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。

6、其余五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	33,860.55
2	应收证券清算款	2,303,921.81
3	应收股利	-
4	应收利息	7,272,422.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,610,205.03

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
景顺长城泰恒回报混合 A 类	239	755,626.29	180,577,614.84	99.99	17,067.47	0.01
景顺长城泰恒回报混合 C 类	35	8,040,939.26	281,274,231.44	99.94	158,642.64	0.06
合计	274	1,686,231.96	461,851,846.28	99.96	175,710.11	0.04

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	景顺长城泰恒回报混合 A 类	4,151.80	0.002299
	景顺长城泰恒回报混合 C 类	133,226.86	0.047339
	合计	137,378.66	0.029734

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	------	--------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	景顺长城泰恒回报混合 A 类	0~10
	景顺长城泰恒回报混合 C 类	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城泰恒回报混合 A 类	0~10
	景顺长城泰恒回报混合 C 类	-
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城泰恒回报混合 A 类	景顺长城泰恒回报混合 C 类
基金合同生效日 (2018 年 1 月 25 日) 基金份额总额	177,072,352.63	162,402,290.32
本报告期期初基金份额总额	345,541,878.41	129,163,744.76
本报告期基金总申购份额	55,671,869.07	216,691,709.38
减：本报告期基金总赎回份额	220,619,065.17	64,422,580.06
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	180,594,682.31	281,432,874.08

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深

圳监管局。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

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	
广发证券股份有限公司	1	109,509,456.31	20.37%	101,986.83	20.37%	-
东北证券股份有限公司	1	95,575,712.89	17.77%	89,011.28	17.77%	-
西部证券股份有限公司	2	88,710,181.79	16.50%	82,616.71	16.50%	-
光大证券股份有限公司	2	76,137,323.60	14.16%	70,906.78	14.16%	-
中泰证券股份有限公司	2	56,436,669.27	10.50%	52,558.92	10.50%	-

东方证券股份 有限公司	1	31,029,791.36	5.77%	28,898.34	5.77%	-
东方财富证 券股份有限 公司	2	24,944,630.65	4.64%	23,230.88	4.64%	-
长城证券股 份有限公司	2	20,064,980.08	3.73%	18,687.71	3.73%	-
中银国际证 券股份有限 公司	1	13,333,246.38	2.48%	12,417.24	2.48%	-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	9,285,949.83	1.73%	8,647.98	1.73%	-
渤海证券股 份有限公司	1	8,169,744.55	1.52%	7,608.48	1.52%	本期 退租 1 个
国信证券股 份有限公司	2	1,741,368.87	0.32%	1,621.74	0.32%	-
汇丰前海证 券有限责任 公司	1	862,840.32	0.16%	803.57	0.16%	-
天风证券股 份有限公司	1	558,894.69	0.10%	520.49	0.10%	-
方正证券股 份有限公司	1	494,998.54	0.09%	460.98	0.09%	-
中信建投证 券股份有限 公司	2	416,907.84	0.08%	388.27	0.08%	-
长江证券股 份有限公司	1	227,447.68	0.04%	211.82	0.04%	-

中国国际金 融股份有限 公司	1	206,784.00	0.04%	192.57	0.04%	-
安信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

广发证券股份有限公司	1,161,198.70	0.30%	220,000,000.00	10.90%	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	3,000,000.00	0.15%	-	-
西部证券股份有限公司	29,962,660.27	7.82%	527,000,000.00	26.10%	-	-
光大证券股份有限公司	101,916.30	0.03%	731,000,000.00	36.21%	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	25,000,000.00	1.24%	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	300,000,000.00	14.86%	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	75,000,000.00	3.71%	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	351,909,799.34	91.85%	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	80,000,000.00	3.96%	-	-
方正证券股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
中信建投证券股份有限公司			58,000,000.00	2.87%		
长江证券股份有限公司						
中国国际金融股份有限公司						
安信证券股份有限公司						
华创证券有限责任公司						
招商证券股份有限公司						
中信证券股份有限公司						

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	关于景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金新增好买基金为销售机构并开通转换业务及参加申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-18
4	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
5	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
6	景顺长城泰恒回报灵活配置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
7	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
8	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	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-09

	下基金销售业务的公告		
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景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-27
11	景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-03
12	景顺长城泰恒回报灵活配置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	2021-03-03
13	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
14	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
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-26
16	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
17	景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
18	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
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	2021-04-02
20	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
21	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
22	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
23	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
24	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
25	景顺长城泰恒回报灵活配置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
26	关于景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金限制接受壹佰万元以上申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-23
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	2021-04-23
28	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12

29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金暂停或限制大额申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-14
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	2021-05-20
31	景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-28
32	景顺长城泰恒回报灵活配置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	2021-05-28
33	关于景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金新增招商银行股份有限公司招赢通平台为销售平台及参加申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-31
34	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
35	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-15
36	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
37	景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 3 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
38	景顺长城泰恒回报灵活配置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
39	景顺长城泰恒回报灵活配置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	20210528-20210630	7,140,816.91	112,579,190.11	13,320,817.11	106,399,189.91	23.03
	2	20210101-20210421; 20210517-20210527	105,388,182.39	-	105,388,182.39	-	-

3	20210101-20210516	112,574,226.55	-	46,411,470.50	66,162,756.05	14.32
产品特有风险						
<p>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：</p> <p>1、大额申购风险</p> <p>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。</p> <p>2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p> <p>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。</p>						

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恒回报灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2021 年 8 月 23 日