

景顺长城安鑫回报一年持有期混合型证券
投资基金
2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 1 月 21 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 10 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城安鑫回报一年持有期混合
基金主代码	009499
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 10 日
报告期末基金份额总额	587,781,120.84 份
投资目标	本基金主要通过投资于固定收益类资产获得稳健收益，同时投资于具备良好盈利能力的上市公司所发行的股票以增强收益，在严格控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	<p>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</p>

	<p>审核后形成资产配置方案。</p> <p>2、债券投资策略 债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>3、资产支持证券投资策略 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，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>4、股票投资策略 本基金以基本面为核心，确定行业配置方向，并结合宏观政策、情绪与技术面指标，在风险可控的范围内积极进行战术性仓位管理，使得风险收益比最大化。</p> <p>5、股指期货投资策略 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。</p> <p>6、国债期货投资策略 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。</p> <p>7、股票期权投资策略 本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p>8、融资策略 本基金在参与融资业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p>
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×90% + 沪深 300 指数收益率×10%。
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。
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司

基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	景顺长城安鑫回报一年持有期混合 A 类	景顺长城安鑫回报一年持有期混合 C 类
下属分级基金的交易代码	009499	009755
报告期末下属分级基金的份额总额	512,768,344.73 份	75,012,776.11 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日）	
	景顺长城安鑫回报一年持有期混合 A 类	景顺长城安鑫回报一年持有期混合 C 类
1. 本期已实现收益	18,467,315.83	2,616,454.25
2. 本期利润	22,144,723.64	3,145,307.17
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0434	0.0423
4. 期末基金资产净值	535,669,337.95	78,214,092.35
5. 期末基金份额净值	1.0446	1.0426

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、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 本报告期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

景顺长城安鑫回报一年持有期混合 A 类

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.33%	0.27%	2.42%	0.11%	1.91%	0.16%
自基金合同生效起至今	4.46%	0.20%	2.03%	0.13%	2.43%	0.07%

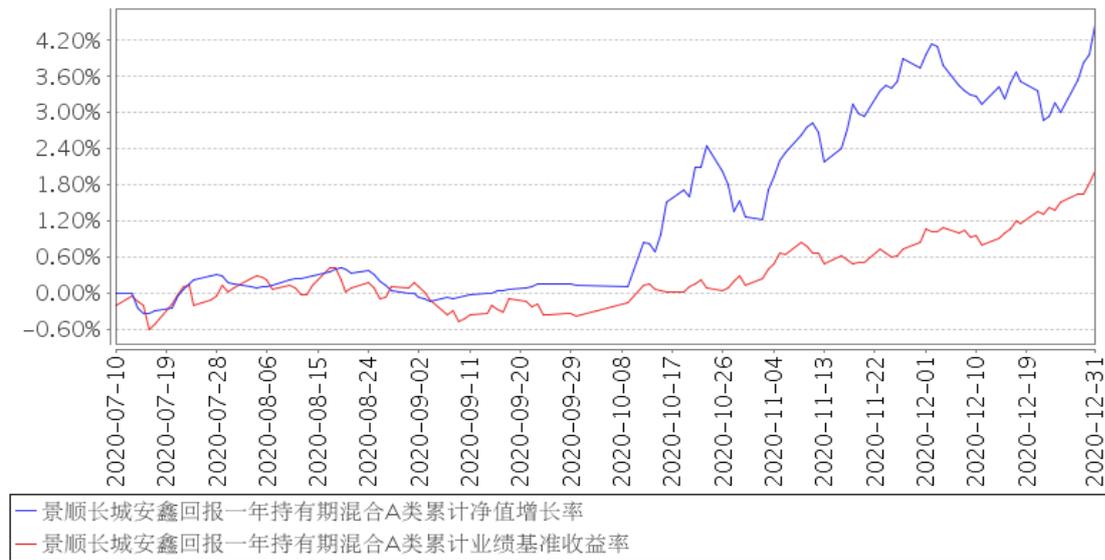
景顺长城安鑫回报一年持有期混合 C 类

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.23%	0.27%	2.42%	0.11%	1.81%	0.16%
自基金合同生效起至今	4.26%	0.20%	2.03%	0.13%	2.23%	0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

景顺长城安鑫回报一年持有期混合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



景顺长城安鑫回报一年持有期混合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 0-30%；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 7 月 10 日基金合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2020 年 7 月 10 日）起至本报告期末不满一年。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
彭成军	本基金的基金经理、固定收益部投资总监	2020年9月12日	-	13年	理学硕士。曾任职于光大银行资金部交易员，民生银行金融市场部投资管理中心和交易中心总经理助理，东方基金管理有限责任公司总经理助理兼固定收益投资总监。2019年5月加入本公司，担任固定收益部投资总监兼基金经理。
韩文强	本基金的基金经理、股票投资部投资副总监	2020年7月10日	-	11年	管理学博士。曾先后担任中国人寿资产管理有限公司研究员、投资经理。2019年8月加入我公司，担任股票投资部投资副总监，自2019年10月起担任股票投资部基金经理，现任股票投资部投资副总监兼基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 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、《景顺长城安鑫回报一年持有期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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011

年修订)》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 1 次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，公司旗下指数基金因指数成份股调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间虽然存在交易所证券临近交易日同向交易和银行间债券 5 日内反向交易，但结合交易时机及市场交易价格波动分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度宏观经济方面，海外经济在强力的财政刺激政策下，处在持续恢复状态之中，并呈现供需两旺的状态。边际变化上，9000 亿美元的新一轮财政刺激计划最终落地，一次性补贴 600 美元、失业补贴降至 300 美元/周，这会在边际上一定程度上实际降低美国的消费需求，同时，海外疫情持续处于失控状态，虽然疫苗领域进展迅速，但实现全民接种，社会秩序全面恢复可能仍将远远晚于目前的市场预期。国内方面，经济弱复苏的势头仍在延续，外需拉动工业生产持续超预期，投资中制造业投资增速加速恢复。近期多省份出现“限电”情况，一方面体现的是短期经济恢复动能仍比较强，需求强劲带来产出缺口扩大，另一方面未来对经济的影响可能从量的变化，转变为对价格的推动，并可能限制后续工业生产进一步反弹的高度。房地产与基建投资温和回落，消费继续恢复，但是近几个月的恢复速度持续不达预期，通胀方面仍呈现出温和再通胀的状态。政策方面，市场高度关注的中央经济工作会议定调较为中性，2021 年经济仍面临内外部不确定性，政策不搞“急转弯”，政策（特别是财政政策）退出的力度可能较为温和，货币政策由“合理充裕”变为“合理适度”边际收敛也并不意外。预计 2020 年全年 GDP 增速将达到 2% 左右，而 2021 年全年有望实现 9% 左右的增长，综合两年的增长来看也大体处于潜在增速水平附近，受基数影响 2021 年各季度 GDP 增速大体呈现出前高后低的走势，对上半年的经济高增长基本已成市场共识，而下半年的经济增长情况目前仍有不少不确定性以及争议，争议焦点在于出口以及制造业投资景气度的可持续性、基建房地产投资回落幅度。2021 年 3 月份开始社融增速将开始明显下降、形成“紧信用”环境，而货币政策大体将维持现状、保持合理适度。

权益策略方面本基金在大部分时间维持了一个较高的仓位，市场已经消化流动性从增量持仓到存量市场这一变量。随着经济进入表观修复最快的阶段，以及成长资产和传统低估值资产的估

值差越来越大，我们认为低估值资产的修复已经进入时间窗口。我们将组合主要配置到了估值比较低同时跟经济相关性较高的板块。这一策略在四季度前两个月取得了预期的效果，但是在最后一个月再次显著落后于成长组合。由于市场已经进入存量行情，资金无法支持全面上涨，当成长资产上涨，低估资产就下跌。而当低估资产上涨，成长资产就下跌，有如跷跷板一样。市场在牛市两年后，赚钱效应显著，趋势投资大行其道，低估值组合在 12 月初突破失败后迅速被趋势资金抛弃。正如《周期》所描述，钟摆一定会摆到极致的位置，我们虽然认为低估组合相对成长组合的风险收益比更高，比如地产龙头 ROE20%低于白酒龙头 ROE30%，对应确是 1.6 倍 pb 和 16 倍 pb 十倍估值差的差别，但市场先生仍然选择继续让两类资产继续朝着不同的极致方向继续摆动，仿佛我们会一直喝酒却不再需要房子。我们尊重趋势，在我们的投资框架里景气度投资本质就是趋势投资，只是我们无法在显然泡沫的估值水平下仍然追逐趋势。出于我们对整个行情进入牛市第四节的判断，我们的策略对应采取防御性投资而非全面进攻。我们拿的资产就算不估值修复，也会在可见的未来钟摆变向后保护我们的回撤，让我们的组合在成长组合越涨越快的冲顶阶段显得特别缺乏进攻性，而比别人赚得少会使大多数人焦虑，这也会反过来再次强化越贵越涨越便宜越不涨。从股票市场的角度来说，我们认为从 2019 年初开始的这轮牛市行情已经进入第四节，绝对意义上的便宜货只剩下银行地产等低估值资产。进入春季躁动区间，风险偏好提高，各种科技类主题投资也有投资机会。

债券策略方面，信用环境的边际放缓，将明显降低投资者风险偏好，不排除阶段性信用事件对市场造成流动性冲击。利率债和中高等级信用债行情将明显受益于当前信用环境，从供需来看，2021 年供需环境也将明显优于 2020 年。货币政策方面，从长周期看相对平稳，对于债市也相对有利。对于中低等级信用债券我们将继续保持谨慎态度，防范信用风险，并防范可能存在的流动性冲击。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2020 年 4 季度，景顺长城安鑫回报混合 A 类份额净值增长率为 4.33%，业绩比较基准收益率为 2.42%。

2020 年 4 季度，景顺长城安鑫回报混合 C 类份额净值增长率为 4.23%，业绩比较基准收益率为 2.42%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	95,392,614.94	11.39
	其中：股票	95,392,614.94	11.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	520,054,157.00	62.10
	其中：债券	500,024,157.00	59.70
	资产支持证券	20,030,000.00	2.39
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	51,800,000.00	6.19
	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	52,364,011.25	6.25
8	其他资产	117,882,445.61	14.08
9	合计	837,493,228.80	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	191,169.48	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,716.24	0.00
J	金融业	64,859,942.08	10.57
K	房地产业	30,322,787.14	4.94
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	95,392,614.94	15.54

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601601	中国太保	824,887	31,675,660.80	5.16
2	601166	兴业银行	1,328,400	27,723,708.00	4.52
3	000002	万科A	544,501	15,627,178.70	2.55
4	600383	金地集团	987,032	13,324,932.00	2.17
5	601318	中国平安	37,100	3,226,958.00	0.53
6	000001	平安银行	115,492	2,233,615.28	0.36
7	600048	保利地产	86,642	1,370,676.44	0.22
8	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.02
9	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
10	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	7,296,107.40	1.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,453,049.60	4.80
	其中：政策性金融债	29,453,049.60	4.80
4	企业债券	382,117,000.00	62.25
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	80,819,000.00	13.17
7	可转债（可交换债）	339,000.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	500,024,157.00	81.45

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	155277	19 川发 01	400,000	40,800,000.00	6.65
2	143470	18 建材 10	400,000	40,724,000.00	6.63
3	155029	18 青城 05	400,000	40,620,000.00	6.62
4	112776	18 中海 01	400,000	40,260,000.00	6.56
5	163529	20 诚通 08	400,000	38,988,000.00	6.35

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值
----	------	------	-------	---------	---------

					比例 (%)
1	169849	20 花 05A1	200,000	20,030,000.00	3.26

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计 (元)					-
国债期货投资本期收益 (元)					-126,750.00
国债期货投资本期公允价值变动 (元)					-

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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、平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”，股票代码：000001）于 2020 年 1 月 20 日收到中国银保监会深圳监管局出具的行政处罚决定书（深银保监罚决字〔2020〕7 号）。其因汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成、代理保险销售的人员为非商业银行人员等问题，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 720 万元罚款。

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。

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。

2、中国平安保险(集团)股份有限公司（以下简称“中国平安”，股票代码：601318）因其子公司中国平安财产保险股份有限公司于 2020 年 8 月 6 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〕58 号）。其因未按车辆实际使用性质承保商业车险行为违反了《保险法》第一百三十五条的规定，被罚款 50 万元。手续费支出未分摊至各分支机构行为违反了《保险法》第八十六条的规定，被罚款 25 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中国平安进行了投资。

3、兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码：601166）因其信用卡中心于 2020 年 10 月 22 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〔2020〕23 号）。其因信用卡授信审批严重违反审慎经营规则问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》的相关规定，被处以 50 万元罚款。

兴业银行于 2020 年 8 月 31 日收到中国银保监会福建监管局出具的行政处罚决定书（闽银保监罚决字〔2020〕24 号）。其因同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权等问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》的相关规定，被处以没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元。

2020 年 8 月 21 日，兴业银行资金营运中心因黄金租赁业务严重违反审慎经营规则，违反了

《中华人民共和国银行业监督管理法》，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〕18号)，被处以罚款人民币 50 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兴业银行进行了投资。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	198,580.55
2	应收证券清算款	110,191,903.02
3	应收股利	-
4	应收利息	7,486,012.26
5	应收申购款	5,949.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	117,882,445.61

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688617	惠泰医疗	124,571.58	0.02	新股流通受限

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城安鑫回报一年持有期混合 A 类	景顺长城安鑫回报一年持有期混合 C 类
报告期期初基金份额总额	508,201,141.27	73,769,697.70
报告期期间基金总申购份额	4,567,203.46	1,243,078.41
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	512,768,344.73	75,012,776.11

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本期末运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期末运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 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信息披露管理办法》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及本基金基金合同、更新招募说明书等规定，经与基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司对本基金参与存托凭证投资修订基金合同等法律文件，包括明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法等，并在基金合同、基金招募说明书（更新）、产品资料概要中增加投资存托凭证的风险揭示。本次修订属于法律法规规定无需召开基金份额持有人大会的事项，修订自 2020 年 11 月 4 日起正式生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 11 月 4 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同等法律文件的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城安鑫回报一年持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城安鑫回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城安鑫回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城安鑫回报一年持有期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。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

9.3 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 1 月 21 日