

景顺长城安泽回报一年持有期混合型证券
投资基金
2021 年第 2 季度报告

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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 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 2021 年 04 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	景顺长城安泽回报一年持有期混合
基金主代码	011018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 29 日
报告期末基金份额总额	731,085,059.14 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。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、信用债投资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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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	$\text{中证综合债指数收益率} \times 85\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 10\% + \text{恒生指数收益率（使用估值汇率折算）} \times 5\%$
风险收益特征	<p>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。</p> <p>本基金还可投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、</p>

	市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	景顺长城安泽回报一年持有期混合 A 类	景顺长城安泽回报一年持有期混合 C 类
下属分级基金的交易代码	011018	011019
报告期末下属分级基金的份额总额	706,238,123.68 份	24,846,935.46 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（2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日）	
	景顺长城安泽回报一年持有期混合 A 类	景顺长城安泽回报一年持有期混合 C 类
1. 本期已实现收益	4,277,760.82	125,507.03
2. 本期利润	6,461,313.45	202,286.32
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0091	0.0081
4. 期末基金资产净值	712,667,142.73	25,047,583.19
5. 期末基金份额净值	1.0091	1.0080

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、本基金基金合同生效日为 2021 年 3 月 29 日。

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

景顺长城安泽回报一年持有期混合 A 类

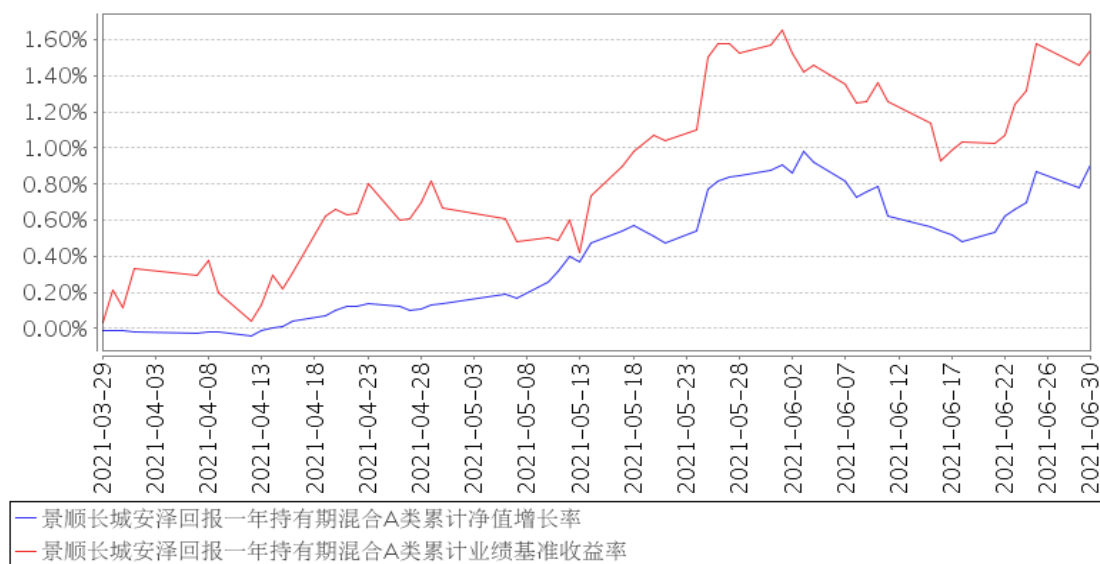
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.92%	0.07%	1.43%	0.13%	-0.51%	-0.06%
自基金合同生效起至今	0.91%	0.06%	1.54%	0.13%	-0.63%	-0.07%

景顺长城安泽回报一年持有期混合 C 类

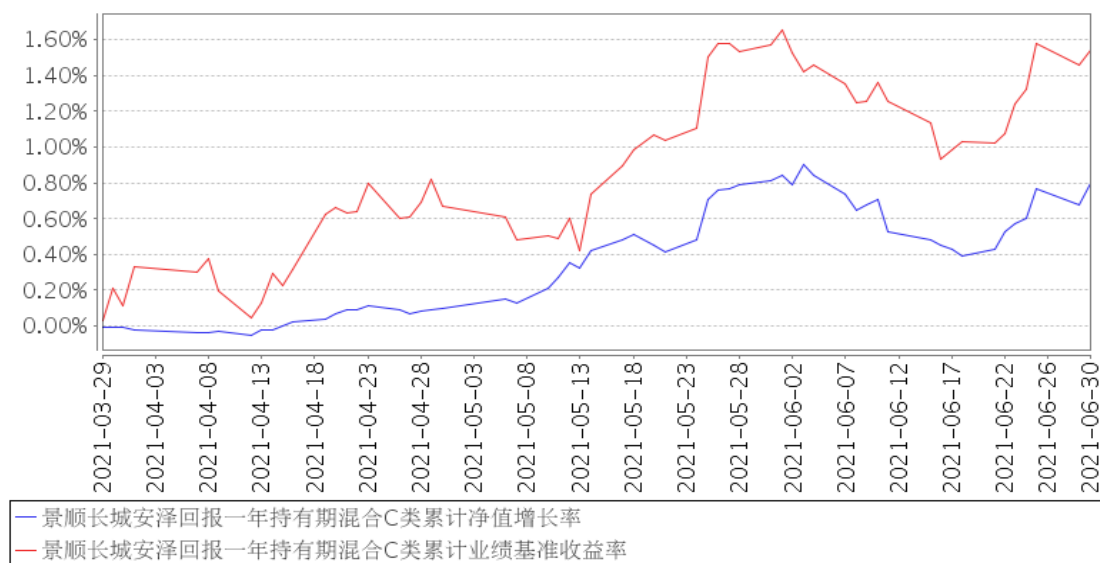
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.81%	0.07%	1.43%	0.13%	-0.62%	-0.06%
自基金合同生效起至今	0.80%	0.06%	1.54%	0.13%	-0.74%	-0.07%

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

景顺长城安泽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



景顺长城安泽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 0-40%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 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 2021 年 3 月 29 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（2021 年 3 月 29 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		
李怡文	本基金的基金经理	2021 年 4 月 30 日	-	15.0 年	工商管理硕士。曾任国家外汇管理局会计处组合分析师，佛罗里瑞伟投资管理公司研究员，中国建设银行香港组合管理经理，国投瑞银基金管理有限公司固定收益部副总监、基金经理。2020 年 4 月加入本公司，自 2021 年 4 月起担任固定收益部基金经理，现任固定收益部稳定收益业务投资负责人、基金经理。具有 15 年证券、基金行业从业经验。

毛从容	本基金的 基金经理	2021 年 3 月 29 日	-	21 年	经济学硕士。曾任职于交通银行及担任长城证券金融研究所债券业务小组组长。2003 年 3 月加入本公司，担任研究部研究员，自 2005 年 6 月起担任基金经理，现任公司副总经理、固定收益部基金经理。具有 21 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。

4.1.1 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

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、《景顺长城安泽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 4 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

相比 1 季度，2021 年 2 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、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；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。

债券方面，受持续宽松的资金面及环比走弱的经济基本面推动，2 季度债券收益率持续下行，10 年期国开债收益率回落近 10bp，而短端收益率下行幅度更大，1 年期国开债下行幅度超过 30BP。

权益市场方面，指数整体以反弹为主，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 1 季度抛售后，在 2 季度也出现大幅反弹，而部分受经济景气程度影响较大的行业和个股则跌幅较大。上证指数当季上涨 4.34%，沪深 300 上涨 3.48%，创业板指涨 26%，破前期高点。

本基金于 1 季度末成立，2 季度开始积极建仓，我们由于对债券市场相对乐观，我们重点配置了高等级信用债以及长久期利率债。对于股票市场，我们相对谨慎，配置方向主要偏向于估值不贵、盈利情况有保障的银行、港口以及食品饮料等板块，以及部分景气程度较高的行业和个股。

展望下半年，从经济基本面看，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，短期内经济回落的趋势仍在延续，短期内还看不到企稳的迹象。而进入 3 季度，美联储货币政策也进入一个敏感时点，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。因此，我们对于国内债券市场保持相对乐观的态度，对股票市场则保持相对谨慎，我们将维持相对较低的股票仓位，等待合适的配置机会。行业上我们将继续重点关注并配置能源革命中的新能源行业、制造业升级过程中进口替代空间大的高端基础材料和新材料行业、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、粮食安全领域以及国家安全领域等的行业和个股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2021 年 2 季度，景顺长城安泽回报 A 类份额净值增长率为 0.92%，业绩比较基准收益率为 1.43%。

2021 年 2 季度，景顺长城安泽回报 C 类份额净值增长率为 0.81%，业绩比较基准收益率为 1.43%。

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	85,255,746.40	11.50
	其中：股票	85,255,746.40	11.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	605,529,980.40	81.68
	其中：债券	605,529,980.40	81.68
	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	28,650,149.93	3.86
	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	15,248,331.30	2.06
8	其他资产	6,700,603.45	0.90
9	合计	741,384,811.48	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 7,365,459.82 元，占基金资产净值的比例为 1.00%。

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	7,871,700.00	1.07
C	制造业	30,011,376.35	4.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	3,524,576.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	8,875,539.00	1.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,230.40	0.00
J	金融业	23,151,604.00	3.14
K	房地产业	2,583,784.00	0.35
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	1,835,442.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	77,890,286.58	10.56

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
周期性消费品	-	-
非周期性消费品	-	-
综合	-	-
能源	5,113,697.41	0.69
金融	-	-
工业	898,446.70	0.12
信息技术	-	-
公用事业	-	-
通讯	1,353,315.71	0.18
合计	7,365,459.82	1.00

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	600519	贵州茅台	4,600	9,460,820.00	1.28
2	600018	上港集团	1,860,700	8,875,539.00	1.20
3	601658	邮储银行	1,738,200	8,725,764.00	1.18
4	601939	建设银行	1,296,600	8,622,390.00	1.17
5	600028	中国石化	1,499,400	6,537,384.00	0.89
6	00883	中国海洋石油	696,000	5,113,697.41	0.69
7	601229	上海银行	620,200	5,085,640.00	0.69
8	600104	上汽集团	204,200	4,486,274.00	0.61
9	000733	振华科技	67,900	4,146,653.00	0.56
10	600456	宝钛股份	69,100	2,964,390.00	0.40

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

无。

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	77,717,440.40	10.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,001,000.00	1.36
	其中：政策性金融债	10,001,000.00	1.36
4	企业债券	331,087,000.00	44.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	50,265,000.00	6.81
7	可转债（可交换债）	68,298,540.00	9.26
8	同业存单	68,161,000.00	9.24
9	其他	-	-
10	合计	605,529,980.40	82.08

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	175361	20 茅台 01	600,000	59,652,000.00	8.09
2	112105071	21 建设银行 CD071	500,000	48,575,000.00	6.58
3	132009	17 中油 EB	464,760	47,823,804.00	6.48
4	143526	18 老窖 01	400,000	40,376,000.00	5.47
5	019536	16 国债 08	313,610	30,787,093.70	4.17

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

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、2020 年 7 月 13 日，中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”，股票代码：601939、0939.HK）因内控管理不到位、支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件等多项问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》的相关规定，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）32 号），被处以罚款人民币 3920 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建设银行进行了投资。

2、上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”，股票代码：601229）于 2020 年 11 月 18 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）25 号）。其因 2014 年至 2018 年绩效考评管理严重违反审慎经营规则、2018 年未按规定延期支付 2017 年度绩效薪酬等问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、《中国银行业监督管理委员会关于印发银行业金融机构绩效考评监管指引的通知》（银

监发〔2012〕34号)第三十二条、《商业银行稳健薪酬监管指引》(银监发〔2010〕14号)第二十五条的相关规定,被处以罚款人民币80万元。

2020年8月14日,上海银行违规向资本金不足、“四证”不全的房地产项目发放贷款,以其他贷款科目发放房地产开发贷款、并购贷款管理严重违反审慎经营规则、经营性物业贷款管理严重违反审慎经营规则等原因,违反了《中华人民共和国商业银行法》第七十三条、第七十四条、第八十条,《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十七条等规定,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〕14号),被处以没收违法所得27.155092万元,罚款1625万元,罚没合计1652.155092万元。

2021年4月25日,上海银行因未按照规定进行信息披露,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)项相关规定,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〕31号),被处以罚款30万元。

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上海银行进行了投资。

3、中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称“邮储银行”,股票代码:601658)于2021年6月22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〕23号)。其因违规向部分客户收取唯一账户《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、第四十七条和相关审慎经营规则,《中华人民共和国商业银行法》第七十三条的相关规定,被处以没收违法所得11.401116万元,罚款437.677425万元,罚没合计449.078541万元。

邮储银行于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〕72号)。其因同业投资业务接受第三方金融机构信用担保、买入返售项下的金融资产不符合监管规定等多项违法违规行,违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条,《中华人民共和国商业银行法》第四十三条、第五十五条、第七十四条和相关审慎经营规则,被处以4550万元罚款。

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邮储银行进行了投资。

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	30,705.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	74,903.28
4	应收利息	6,570,694.28
5	应收申购款	24,300.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,700,603.45

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	132009	17 中油 EB	47,823,804.00	6.48
2	132015	18 中油 EB	18,846,720.00	2.55
3	132004	15 国盛 EB	1,424,016.00	0.19

5.11.5 报告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。

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	景顺长城安泽回报一年持有期混合 A 类	景顺长城安泽回报一年持有期混合 C 类
报告期期初基金份额总额	706,215,539.44	24,840,528.69
报告期期间基金总申购份额	22,584.24	6,406.77
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	706,238,123.68	24,846,935.46

§ 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

基金管理人本期末未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

基金管理人本期末未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

无。

§ 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泽回报一年持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城安泽回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城安泽回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城安泽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 7 月 21 日