

景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券型证  
券投资基金  
2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 24 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 21 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 10 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券   |
| 基金主代码      | 008999   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2020 年 5 月 29 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 4,286,644,693.55 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，同时适当投资于具备良好盈利能力的上市公司所发行的股票，在严格控制风险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>（一）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、中国经济发展情况进行调整，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>（二）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>（三）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>（四）资产支持证券投资策略</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。 |                        |
| 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          | 本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。  |                        |
| 基金管理人           | 景顺长城基金管理有限公司  |                        |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司  |                        |
| 下属分级基金的基金简称     | 景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券 A 类  | 景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券 C 类 |
| 下属分级基金的交易代码     | 008999  | 009000                 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,836,262,636.03 份  | 2,450,382,057.52 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 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日） |                        |
|-----------------|---------------------------------------|------------------------|
|                 | 景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券 A 类                | 景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券 C 类 |
| 1. 本期已实现收益      | 11,803,724.26                         | 7,362,980.13           |
| 2. 本期利润         | 20,955,684.04                         | 8,727,016.88           |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0134                                | 0.0079                 |
| 4. 期末基金资产净值     | 2,081,287,728.67                      | 2,759,424,526.83       |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1334                                | 1.1261                 |

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 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

景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券 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      | 1.22%  | 0.14% | 1.30% | 0.08% | -0.08% | 0.06% |
| 过去六个月      | 3.71%  | 0.16% | 2.16% | 0.11% | 1.55%  | 0.05% |
| 过去一年       | 7.52%  | 0.20% | 4.29% | 0.13% | 3.23%  | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.34% | 0.22% | 7.48% | 0.13% | 5.86%  | 0.09% |

景顺长城景颐嘉利6个月持有期债券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      | 1.10%  | 0.14%     | 1.30%      | 0.08%         | -0.20% | 0.06% |
| 过去六个月      | 3.48%  | 0.16%     | 2.16%      | 0.11%         | 1.32%  | 0.05% |
| 过去一年       | 7.08%  | 0.20%     | 4.29%      | 0.13%         | 2.79%  | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 12.61% | 0.22%     | 7.48%      | 0.13%         | 5.13%  | 0.09% |

### 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

景顺长城景颐嘉利6个月持有期债券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



景顺长城景颐嘉利6个月持有期债券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：投资组合比例：本基金投资于债券资产不低于基金资产的 80%，投资于股票等权益类资产不高于基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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、应收申购款等。本基金的建仓期为自 2020 年 5 月 29 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 |        |   |
| 毛从容 | 本基金的基金经理 | 2020年5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。 |
| 董晗  | 本基金的基金经理 | 2020年10月30日 | -    | 15年    | 理学硕士。曾任易方达基金管理有限公司研究部研究员，国投瑞银基金管理有限公司研究部研究员、投资部基金经理。2020年7月加入本公司，自2020年10月起担任股票投资部基金经理。具有15年证券、基金行业从业经验。      |

|     |            |             |   |     |   |
|-----|------------|-------------|---|-----|---|
| 李怡文 | 本基金的基金经理   | 2021年6月16日  | - | 15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，担任固定收益部稳定收益业务投资负责人，自2021年4月起担任固定收益部基金经理，现任混合资产投资部总经理、基金经理。具有15年证券、基金行业从业经验。 |
| 郭杰  | 本基金的基金经理助理 | 2021年12月17日 | - | 6年  | 金融硕士。曾任太平财产保险有限公司财务部预算审批专员，前海开源基金管理有限公司交易部债券交易员。2016年3月加入本公司，担任交易管理部交易员、固定收益部研究员，现任固定收益部基金经理助理。具有6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

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、《景顺长城景颐嘉利6个月持有期债券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 14 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

2021 年四季度中国经济整体延续了三季度以来的回落走势。出口数据高位震荡，11 月份当月出口同比保持 22% 的较高增速，显示出口仍有一定韧劲。内需相对疲软：11 月份社会消费品零售同比增速为 3.9%，增速环比回落 1 个百分点。而房地产销售、投资数据继续走弱：尽管截止 11 月份的当年累计房地产开发投资增速仍保持正增长，单月房地产开发投资增速自 9 月份以来连续出现个位数的同比下滑，单月销售面积和新开工面积也出现双位数下滑。疲弱的房地产投资数据拖累了整个固定资产投资增速。进入四季度以后，前期缺煤缺电现象大幅缓解，工业增加值增速有所反弹，11 月份单月工业增加值增速 3.8%，比 9 月份低点反弹 0.7 个百分点。在整体经济增长乏力的大背景下，宏观经济政策转向稳增长：12 月份先有降准，后有 1 年期 LPR 调降 5BP，12 月份中央经济工作会议也定调 2022 年经济工作要稳字当头、稳中求进，要求各地区各部门要担负起稳定宏观经济的责任。与国内政策转向稳增长相对比，受通胀压力较大的影响，主要海外经济体加快了宽松政策退出：美联储 Taper 加快，将在明年 3 月份结束购债计划，而对于美国首次加息的预期也提前到明年上半年。

债券市场方面，整个四季度资金面保持宽松，债券收益率在 10 月份有所反弹后继续下行，多个期限的收益率创年内低点。整个四季度来看，10 年期国开债收益率回落约 11bp，1 年期国开债收益率回落 8BP，3-5 年回落幅度最大，约 20bp。

权益市场方面，指数先回落后反弹，上证指数四季度小幅上涨，但行业继续分化：传媒军工等行业表现最好，大消费以及新能源相关板块也表现不俗，而受供应放量、价格回落的影响，三季度表现较好的煤炭行业表现垫底。上证指数当季上涨 2.01%，沪深 300 上涨 1.52%，创业板指反弹 2.40%。

四季度本基金债券组合配置继续偏向中低久期的高等级信用债，以及流动性好的中短久期的利率债，组合久期保持在中性偏低的位置。对于股票组合我们进一步加仓，重点增加了前期跌幅

较大、估值较为合理的消费股和金融股，以及预期未来景气程度将见底回升的交运、地产股等，股票组合结构较为均衡。

展望未来，中国宏观政策从前期调结构转向稳增长，稳增长的方向既定，政策的力度还需要观察，2022 年一季度形势会更为明朗。前瞻地看，经济出现大幅失速下滑的风险并不大，未来经济逐步企稳并温和回升可能性较大。因此我们对股票市场态度偏积极，股票组合将保持相对较高配置，并将进一步优化结构。对债券市场保持中性态度，债券组合维持低久期，将耐心等待合适的配置机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2021 年 4 季度，景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券 A 类份额净值增长率为 1.22%，业绩比较基准收益率为 1.30%。

2021 年 4 季度，景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券 C 类份额净值增长率为 1.10%，业绩比较基准收益率为 1.30%。

#### 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              | 877,323,880.78   | 17.80        |
|    | 其中：股票             | 877,323,880.78   | 17.80        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 3,906,739,438.14 | 79.25        |
|    | 其中：债券             | 3,906,739,438.14 | 79.25        |
|    | 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          | 18,900,000.00    | 0.38         |
|    | 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      | 58,784,541.22    | 1.19         |
| 8  | 其他资产              | 67,833,501.86    | 1.38         |
| 9  | 合计                | 4,929,581,362.00 | 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              | 79,529,950.00  | 1.64         |
| C  | 制造业              | 416,501,066.41 | 8.60         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | 28,242,500.00  | 0.58         |
| F  | 批发和零售业           | 12,623,362.00  | 0.26         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 41,505,042.00  | 0.86         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -              | -            |
| J  | 金融业              | 238,862,070.69 | 4.93         |
| K  | 房地产业             | 46,316,467.68  | 0.96         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 13,743,422.00  | 0.28         |
| 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               | 877,323,880.78 | 18.12        |

## 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 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

| 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 | 992,640   | 37,998,259.20 | 0.78         |
| 2  | 000776 | 广发证券 | 1,458,235 | 35,857,998.65 | 0.74         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 733,700   | 35,738,527.00 | 0.74         |
| 4  | 000001 | 平安银行 | 2,158,158 | 35,566,443.84 | 0.73         |
| 5  | 601658 | 邮储银行 | 6,973,100 | 35,562,810.00 | 0.73         |
| 6  | 601166 | 兴业银行 | 1,725,500 | 32,853,520.00 | 0.68         |
| 7  | 601225 | 陕西煤业 | 2,493,700 | 30,423,140.00 | 0.63         |
| 8  | 001979 | 招商蛇口 | 2,243,252 | 29,924,981.68 | 0.62         |
| 9  | 601668 | 中国建筑 | 5,648,500 | 28,242,500.00 | 0.58         |
| 10 | 601816 | 京沪高铁 | 5,795,200 | 27,990,816.00 | 0.58         |

#### 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      | 64,177,869.30    | 1.33         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 1,059,989,000.00 | 21.90        |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,059,989,000.00 | 21.90        |
| 4  | 企业债券      | 646,582,000.00   | 13.36        |
| 5  | 企业短期融资券   | 210,117,000.00   | 4.34         |
| 6  | 中期票据      | 1,254,898,000.00 | 25.92        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 426,232,568.84   | 8.81         |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | 244,743,000.00   | 5.06         |
| 10 | 合计        | 3,906,739,438.14 | 80.71        |

#### 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  | 210207  | 21 国开 07     | 3,600,000 | 363,780,000.00 | 7.52         |
| 2  | 200203  | 20 国开 03     | 2,100,000 | 213,717,000.00 | 4.41         |
| 3  | 210202  | 21 国开 02     | 1,500,000 | 151,350,000.00 | 3.13         |
| 4  | 132015  | 18 中油 EB     | 1,100,830 | 114,409,261.90 | 2.36         |
| 5  | 1728022 | 17 工商银行二级 02 | 900,000   | 91,368,000.00  | 1.89         |

#### 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国债期货交易情况说明

##### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则，根据风险管理原则，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。

### 5.9.2 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。

### 5.9.3 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。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 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、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），其私人银行部于 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。

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 2021 年 12 月 29 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〔2021〕81 号）。其因信用卡业务管理不到位，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条等规定，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。

2021 年 7 月 30 日，宁波银行因贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储、开发贷款支用审核不严、房地产贷款放款和支用环节审核不严、贷款资金违规流入房市、房地产贷款资金回流借款人、票据业务开展不审慎，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，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〕57 号），被处以罚款人民币 275 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

2021 年 7 月 13 日，宁波银行因违规为存款人多头开立银行结算账户、超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料等，收到中国人民银行宁波市中心支行出具的行政处

罚决定书（甬银处罚字〔2021〕2号），被给予警告，并处罚款 286.2 万元。

2021 年 7 月 13 日，宁波银行因违反规定办理经常项目外汇业务、违反规定办理资本项目资金收付，收到外管局宁波分局出具的行政处罚决定书（甬外管罚〔2021〕7号），被罚款 100 万，没收违法所得 104.85 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宁波银行进行了投资。

3、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。

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。

4、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。

5、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年费和小额账户管理费等问题，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、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 2021 年 8 月 13 日收到中国人民银行出具的行政处罚决定书(银罚字〔2021〕16 号)。其因违反账户管理相关规定，被处以 600 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。

6、兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码：601166）于 2021 年 8 月 13 日收到中国人民银行出具的行政处罚决定书(银罚字〔2021〕26 号)，其因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，被处以罚款人民币 5 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。

7、其余四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。

#### 5.10.2 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。

#### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 261,507.77    |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 58,038,235.61 |
| 5  | 应收申购款   | 9,533,758.48  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 67,833,501.86 |

#### 5.10.4 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  | 132015 | 18 中油 EB | 114,409,261.90 | 2.36         |
| 2  | 110053 | 苏银转债     | 68,571,866.00  | 1.42         |
| 3  | 113011 | 光大转债     | 67,649,998.20  | 1.40         |
| 4  | 113044 | 大秦转债     | 38,224,108.80  | 0.79         |
| 5  | 132009 | 17 中油 EB | 34,290,336.00  | 0.71         |
| 6  | 123107 | 温氏转债     | 17,123,292.84  | 0.35         |
| 7  | 113563 | 柳药转债     | 11,692,891.80  | 0.24         |

|    |        |          |               |      |
|----|--------|----------|---------------|------|
| 8  | 113042 | 上银转债     | 11,134,465.50 | 0.23 |
| 9  | 127018 | 本钢转债     | 6,279,553.80  | 0.13 |
| 10 | 128048 | 张行转债     | 6,022,867.85  | 0.12 |
| 11 | 127020 | 中金转债     | 5,323,833.27  | 0.11 |
| 12 | 110073 | 国投转债     | 5,088,571.20  | 0.11 |
| 13 | 113037 | 紫银转债     | 4,610,731.40  | 0.10 |
| 14 | 113047 | 旗滨转债     | 2,042,350.40  | 0.04 |
| 15 | 110075 | 南航转债     | 1,689,826.50  | 0.03 |
| 16 | 113619 | 世运转债     | 1,372,098.80  | 0.03 |
| 17 | 128129 | 青农转债     | 848,350.80    | 0.02 |
| 18 | 113033 | 利群转债     | 743,500.80    | 0.02 |
| 19 | 123111 | 东财转 3    | 702,992.40    | 0.01 |
| 20 | 128136 | 立讯转债     | 669,019.00    | 0.01 |
| 21 | 128097 | 奥佳转债     | 611,104.00    | 0.01 |
| 22 | 110079 | 杭银转债     | 554,203.00    | 0.01 |
| 23 | 132018 | G 三峡 EB1 | 551,206.00    | 0.01 |
| 24 | 128029 | 太阳转债     | 527,345.00    | 0.01 |
| 25 | 113050 | 南银转债     | 241,372.80    | 0.00 |
| 26 | 110048 | 福能转债     | 214,659.00    | 0.00 |
| 27 | 128123 | 国光转债     | 35,023.80     | 0.00 |

#### 5.10.5 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。

#### 5.10.6 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                        | 景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券 A 类 | 景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券 C 类 |
|---------------------------|------------------------|------------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,260,425,755.94       | 36,912,448.43          |
| 报告期期间基金总申购份额              | 758,783,310.77         | 2,417,204,698.19       |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 182,946,430.68         | 3,735,089.10           |
| 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               | 1,836,262,636.03       | 2,450,382,057.52       |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

### §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自有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期末未运用自有资金投资本基金。

## §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景颐嘉利 6 个月持有期债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券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

2022 年 1 月 24 日