

# 景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告

2022 年 3 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 4 月 22 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 2022 年 4 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 03 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 景顺长城公司治理混合  |
| 场内简称       | 无   |
| 基金主代码      | 260111  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2008 年 10 月 22 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 211,866,372.14 份  |
| 投资目标       | 本基金重点投资于具有良好公司治理的上市公司的股票，以及因治理结构改善而使公司内部管理得到明显提升的上市公司的股票，在控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。   |
| 投资策略       | 本基金依据以宏观经济分析模型（MEM）为基础的资产配置模型决定基金的资产配置，运用景顺长城“股票研究数据库（SRD）”等分析系统，基于公司治理评价体系和 FVMC 等选股模型作为个股选择的依据，同时依据景顺长城风险管理系统和绩效评估系统进行投资组合的调整，以谋求基金资产的长期稳定增值。 |
| 业绩比较基准     | 沪深 300 指数×80%+中证全债指数×20%。   |
| 风险收益特征     | 本基金是风险程度高的投资品种。   |
| 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  |

## §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（2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 5,157,813.33                        |
| 2. 本期利润         | -86,648,308.68                      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.4640                             |
| 4. 期末基金资产净值     | 308,247,210.25                      |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.455                               |

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。

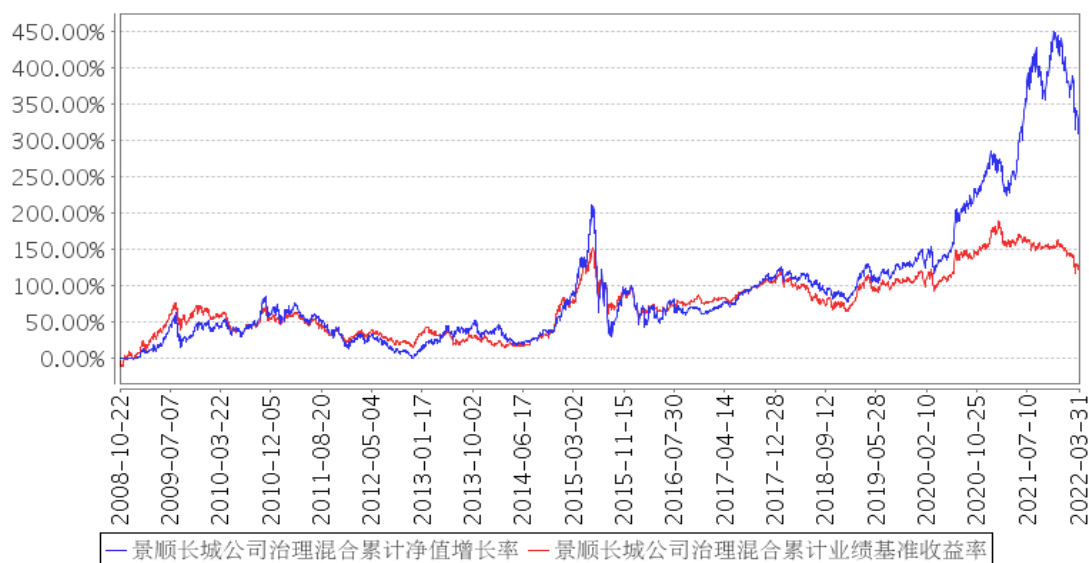
## 3.2 基金净值表现

### 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

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | -23.52%    | 1.68%         | -11.58%        | 1.17%                 | -11.94% | 0.51% |
| 过去六个月          | -11.70%    | 1.48%         | -10.23%        | 0.94%                 | -1.47%  | 0.54% |
| 过去一年           | 24.30%     | 1.51%         | -12.17%        | 0.91%                 | 36.47%  | 0.60% |
| 过去三年           | 87.28%     | 1.34%         | 11.02%         | 1.02%                 | 76.26%  | 0.32% |
| 过去五年           | 139.22%    | 1.19%         | 24.71%         | 0.99%                 | 114.51% | 0.20% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 313.73%    | 1.60%         | 127.39%        | 1.22%                 | 186.34% | 0.38% |

### 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

景顺长城公司治理混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的资产配置比例为：股票投资 65%–95%，债券投资 0%–30%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%–35%，权证投资 0%–3%。本基金投资于基金名称显示投资方向的股票不低于基金股票投资的 80%；本基金自 2008 年 10 月 22 日合同生效日起至 2009 年 4 月 21 日为建仓期。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 |        |  |
| 杨锐文 | 本基金的基金经理 | 2020 年 7 月 25 日 | -    | 12 年   | 工学硕士、理学硕士。曾任上海常春藤衍生投资公司分析部高级分析师。2010 年 11 月加入本公司，担任研究部研究员，自 2014 年 10 月起担任股票投资部基金经理，现任股票投资部执行总监、基金经理。具有 12 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、《景顺长城公司治理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 17 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

本季度，全球新冠疫情有所缓和，流动性预期变化导致全球资本市场急剧动荡，尤其 A 股也同样出现剧烈的波动。本季度，基金重仓股表现弱势，普遍跑输指数，沪深 300、中小板指、创业板指分别下跌 14.53%、18.64%、19.96%。

本季度，本基金跑输了基准，并录得本基金成立以来最大的单季度回撤。除了周期类和低估值的个股之外，无论是成长类还是消费类，跌幅都相差不大。本季度，我们组合持股依然以成长股为主，回撤均不小，因此，本基金给持有人带来一定的亏损，我们深感抱歉。尽管当前市场表现依然很萎靡，但是，我们现在信心是更充足的。从本人当基金经理以来，经历了 2015-2016

年的三轮股灾、2018 年的暴跌，几乎每年都会经历将近 20%幅度的市场回撤，每次到那种跌到市场自我怀疑的时候，这个市场就见底了。尽管很多人很悲观，当前市场也很萎靡，但是，我们对我们的投资的方向与组合依然充满信心。我们依然坚持投资具有伟大前景的新兴产业企业，并伴随他们的成长，而不是趋势增强、寻求市场热点。我们相信未来的胜者一定是不断高强度投入的企业。尽管这些企业不一定是当前的焦点，但是，我们相信厚积薄发才能换取长期的发展。尽管这个过程充满艰难与痛苦，我们仍会坚持我们的选择和风格，我们也会不断优化和改进我们的持仓组合。本基金始终坚持投资于符合产业趋势的真正的成长股，基金仓位处于基金合同规定仓位限制中的高仓位（88%-95%）。

我们去年年报对今年市场是谨慎乐观的，但是，今年开年的走势是彻底打了我们的脸。为什么会出现这样的误判？我们过去曾经说过，可预知的风险并不是风险，不可预知的风险才是真正的风险。今年以来，市场出现了三个难以预知的风险：1、俄乌战争的发生以及引发的一系列冲击；2、奥密克戎疫情多点爆发，传播速度和冲击程度均超出预期；3、过去的一些政策出现了“非意图后果”，一定程度上阻碍了信用扩张，影响了投资者信心。

前期，市场的大幅下跌主要是这三个因素引发的，但是，我们今天看到了越来越多积极的信号。其中，金融委于 3 月 16 日就开会针对相关政策和稳定预期的问题进行一系列的具体部署，我们也看到了负面政策逐步调整，相信不久的将来，信用扩张的阻碍都会被清除。至于疫情的影响，政府也在动态调整政策以平衡经济与控制疫情之间的关系。俄乌战争对市场情绪的最大冲击也已经过去，考虑到每天战争状态的物质消耗，持久战的概率并不太大，停战也是随时可能发生的。我们可以看到每一点因素都在改善，投资其实更多是看预期。尽管现在似乎有各种各样的风险，但是，如果市场认为未来会好，市场就会上涨。在这个时候，我们更应该抗拒内心的恐惧，审视自身组合的内在逻辑，坚持必要的坚持。

或许不少投资者都因亏损而担心与焦虑，我们认为有必要详细分享一下我们的投资思考逻辑。希望大家了解我们的投资思考之后，能继续保持耐心，继续支持我们。我们也希望在这次阶段性的回撤之后，继续能给投资者带来稳定的回报。

#### 我们对投资的一些思考

市场有人把这次滞胀风险类比美国 70 年代，但是，我们并不认为这样滞胀的状态会持续。因为 70 年代的滞胀很重要的因素是美国战后婴儿潮带来了总需求扩张，能源供给无法跟上需求的爆发，因此，这带来较长时间的滞胀。但是，这一次并没有出现总需求扩张，最重要的因素是新冠疫情的爆发带来全球性的供给效率下降，体现在原材料供给不足和产能建设放缓、航运效率下降以及很多行业均出现生产效率明显下降等方面。然而，需求侧则因为欧美发钱的一次性刺激，

消费出现不降反升的状态。因此，供需平衡走向了供需严重失衡。自从俄乌战争以来，西方社会对俄罗斯进行了全面性的制裁，其中影响最大的是将俄罗斯踢出 SWIFT 系统。考虑到俄罗斯是全球主要的油气、矿产、粮食等基础资源的出口国之一，这更是加剧了全球资源、能源和粮食供给的紧张状况，加重了市场对滞胀风险的担忧。但是，后续随着欧美加息和刺激政策的逐步退出，因为过度刺激而阶段性扩张的总需求可能转为收缩，以及俄罗斯资源贸易关系的重构，全球供需格局将走向再平衡。因此，我们认为滞胀只是阶段性的，市场的再平衡需要一定的时间。

俄乌战争更多是影响市场信心，并不会对中国带来实质性影响。中国在全球制造业产值中占据 30% 份额，由于我们在中低端制造业更具有优势，如果从产量的角度，占比肯定是更高的，可能超过了 50% 以上。虽然以美国为代表的欧美发达国家一直尝试在中国以外的国家和地区建立新的供应链体系，但必须客观承认的是，全球经济已经和中国制造业深度融合，即使俄乌战争影响了全球化的进程，从制造业转移的可能性看，当下无论印度还是东南亚，在基础设施、人员素质、大规模人员流动以及内需市场都是全方面落后于中国，中国制造业的比较优势无与伦比。即使有些国家强行转移，基础设施的建设没有十年以上是无法做到的，强行从中国转移出去意味着牺牲供应链的效率，这在残酷的商业竞争中无异于自断双臂，这也是漫长的过程。相反，无论是欧洲因能源供给不足导致的生活成本急剧上升，还是俄罗斯因被制裁导致的国际贸易瘫痪，对于我们而言都是一场极为深刻且难得的教训和实践预演，将会全面加速我们自主可控的节奏。无论是制造业自主可控还是资源自主可控，可能都会全面性加速。中国是世界上工业体系最健全的国家，庞大的内需带来我们的制造业强大的规模效应，这也赋予中国经济强大的韧性。

如果俄乌局势缓和，那么商品价格可能急速回落，风险偏好将重新恢复，市场可能在短时间出现较大反弹。从情绪上的冲击可能已经到达最悲观的状态，实际对中国的影响微乎其微。但是，这次俄乌事件将会坚定我们自主可控的决心，欧洲也会努力争取能源独立，俄乌战争对后续的产业发展会带来深刻的变革。正如，2018 年贸易摩擦之后，我国的自主可控产业全面爆发，这次也是更坚定了我们这方面的信念。

就投资机会而言，我们认为上半年是周期类占优，下半年是科技成长类占优。以有色、煤炭为代表的资源股和以地产、基建为代表的稳增长个股，大概率是上半年的投资主轴，在一季度的行情也充分表露无遗。我们并不倾向于现阶段介入相关板块，主要是我们无法衡量这些机会的空间和高度。尽管科技成长类的机会表现相对萎靡，但是，我们深信这些是未来，随着过度悲观的风险偏好修复，这些板块也会出现估值修复的机会。对于这些机会，我们认为市场高估了短期的风险，低估了长期的空间与机会。因此，我们的布局上依然以科技成长为主，并且，这次科技成长的领军方向将会以半导体、新材料、软件等为代表的自主可控为主。

我们长期看好的方向

自主可控

俄乌战争爆发之后，俄罗斯遭受了前所未有的制裁，这将会更坚定我们大力推动自主可控的决心。自主可控有很多层面，我们主要是分析工业及信息产业层面的自主可控，包括芯片、软件、新材料等。自从中美贸易摩擦之后，自主可控产业迎来了爆发式增长。正如今天的半导体产业和四年前的半导体产业已经不可同日而语，国内出现了越来越多有竞争力的企业，在不同的领域和产品中均出现零的突破。当然，由于受到疫情的影响，消费电子、服务器等产业表现相对萎靡，一定程度上制约了相关芯片、软件行业的发展。但是，半导体产业几乎覆盖了工业及信息产业的各个细分领域，东方不亮西方亮，未来的投资将更看重细分领域，我们将更加注重自下而上的个股选择。

科技品牌产品

本季度，我们组合增加了以扫地机器人、短途出行工具、投影仪为代表的科技品牌产品的持仓。过去，A 股的科技股主要是 2B 业务主导的零部件公司，很少有 2C 业务主导的产品型公司，也就是过去的科技股更多以制造为主，少有走向微笑曲线的更上端，以设计研发、品牌为主。随着科创板的推出，我们看到越来越多科技品牌类的公司上市，也看到了这些公司在产品上不断创新、市场份额不断提升。过去，我们看到很多成功的品牌型公司都是以强大的营销能力为主要的推动力，但是，我们今天更重视这些公司是否能打造出让人惊艳的产品，能不能真正给消费者创造价值。我们确信越来越多中国公司能做出具有创新性的产品，相信这些公司最终会展现出强大的爆发力。

电动智能汽车

今年以来，新能源汽车发生了一定的变化，碳酸锂的价格现在已经超过了 50 万/吨，其他的原材料价格也处于高位，这导致了车企面临巨大的成本压力。所以，我们近期也看到各种车企纷纷涨价，价格上涨从几千到几万不等。这种涨价幅度一定会抑制需求，我们认为，后面会看到新能源汽车产业的景气度下行，这个周期可能会长达半年到一年。但是，这对新能源汽车产业并不是坏事，过去的超高增速本就不是常态，产业链的某些环节也需要时间来缓解供需矛盾。经过这次的调整，我们相信新能源汽车产业会更健康发展，还会诞生无数的投资机会。产业的发展从来不是一帆风顺的，我们需要耐心和坚持才能收获好的结果。我们也会主动应对行业的变化，希望能带给投资者更平稳的投资体验。对于行业基金或指数，前期下跌已经反映了部分预期，未来产业的调整或者景气度的下行不代表股票会调整，毕竟股票是提前反映预期的，在这个阶段更需要我们努力甄别机会和风险，更考验我们寻找 alpha 的能力。



### 关于基金的策略容量

我们现在管理的景顺长城优选、环保优势和创新成长等三只基金均定位为全行业基金，主要采取之前季报所描述的企业生命力评估的方法论策略。它们不仅会投资在企业成长爆发阶段，也会有大量投资于陪伴企业成长的早中期阶段，市值分布从 30 亿至万亿不等，行业分布也较为分散，体现为多层次均衡式投资。

景顺长城成长龙头也定位为全行业基金，但是投资的企业会更偏重于大市值龙头成长股。

景顺长城公司治理基金和成长领航基金同样定位于均衡成长，但有较多仓位投资于以专精特新为代表的中小市值股票。

景顺长城电子信息产业与新能源产业均是团队管理的行业型基金，分别聚焦于科技股与新能源产业。由于聚焦于科技股和新能源产业，这两个基金会体现较高的波动率。我们希望通过产业切入的方式实现持续的超额收益，并通过更专业的产业投资让投资者分享产业成长的红利。

### 结束语

尽管过去一个季度市场表现很糟糕，市场及基民的情绪都进入冰点，我们的基金也表现不佳，但是，我们此刻的确是很乐观的，我们认为风险已经体现在过去，机会呈现在未来。我相信，只要坚守在正确的产业方向和优秀的企业上，期望基金终将会给投资者丰厚的回报。我们也会努力做好，希望不辜负投资者的期待。面对百年不遇的变局，资本市场势必动荡加大，面对未来的风浪，我们努力把稳船舵，破浪前行。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

2022 年 1 季度，本基金份额净值增长率为-23.52%，业绩比较基准收益率为-11.58%。

## 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   | 283,502,500.47 | 91.54        |
|    | 其中：股票  | 283,502,500.47 | 91.54        |
| 2  | 基金投资   | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资 | -              | -            |
|    | 其中：债券  | -              | -            |
|    | 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          | -              | -      |
|   | 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      | 22,520,375.06  | 7.27   |
| 8 | 其他资产              | 3,671,314.01   | 1.19   |
| 9 | 合计                | 309,694,189.54 | 100.00 |

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”，“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额，下同。

## 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              | 250,063,221.05 | 81.12        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | 7,110.12       | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 78,105.74      | 0.03         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 13,824,430.40  | 4.48         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 18,913,678.60  | 6.14         |
| J  | 金融业              | -              | -            |
| K  | 房地产业             | -              | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 60,137.54      | 0.02         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 555,817.02     | 0.18         |
| 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               | 283,502,500.47 | 91.97        |

### 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  | 688169 | 石头科技 | 32,081  | 17,778,006.96 | 5.77         |
| 2  | 600460 | 士兰微  | 357,400 | 17,333,900.00 | 5.62         |
| 3  | 002841 | 视源股份 | 235,800 | 15,119,496.00 | 4.90         |
| 4  | 688002 | 睿创微纳 | 332,642 | 14,988,848.52 | 4.86         |
| 5  | 002352 | 顺丰控股 | 302,142 | 13,807,889.40 | 4.48         |
| 6  | 600745 | 闻泰科技 | 167,800 | 13,642,140.00 | 4.43         |
| 7  | 689009 | 九号公司 | 289,310 | 12,668,884.90 | 4.11         |
| 8  | 688116 | 天奈科技 | 74,087  | 10,721,129.77 | 3.48         |
| 9  | 688798 | 艾为电子 | 62,647  | 10,700,107.60 | 3.47         |
| 10 | 688696 | 极米科技 | 26,917  | 10,018,238.23 | 3.25         |

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券投资。

**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**

本基金本报告期末未持有债券投资。

**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**

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

**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**

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。

### 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

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。

## 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、江苏天奈科技股份有限公司（以下简称“天奈科技”，股票代码：688116）于 2021 年 6 月 18 日收到镇江市应急管理局出具的行政处罚决定（（苏镇）应急罚[2021]6 号），其因发行人成品库二层有 2 吨硝酸铝未存放在危化品专用仓库，被给予责令改正，并处人民币伍万柒仟伍佰元罚款。

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天奈科技进行了投资。

2、本基金投资前十名证券的其余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   | 63,826.83    |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,202,147.06 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 1,405,340.12 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 3,671,314.01 |

### 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

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

根据财政部《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》（财会〔2017〕7 号）、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》（财会〔2017〕8 号）、《企业会计准则第 24 号—套期会计》（财会〔2017〕9 号）、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（财会〔2017〕14 号）（以上统称新金融工具相关会计准则）和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22 号），并经与托管人协商一致，自 2022 年 1 月 1 日起，本公司对旗下公开募集证券投资基金开始执行新金融工具相关会计准则。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 151,615,996.55 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 79,437,923.82  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 19,187,548.23  |
| 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               | 211,866,372.14 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## §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公司治理股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城公司治理混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城公司治理混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城公司治理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

2022 年 4 月 22 日