

景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资
基金
2022 年第 2 季度报告

2022 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2022 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 04 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 景顺长城安享回报混合 |
| 场内简称 | 无 |
| 基金主代码 | 001422 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 6 月 15 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 576,045,712.24 份 |
| 投资目标 | 在有效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> |

| | | |
|-----------------|--|------------------|
| | 3、股票投资策略 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。在股票投资方面，本基金利用基金管理人股票研究数据库（SRD）对企业内在价值进行深入细致的分析，并进一步挖掘出受益于中国经济发展趋势和投资主题的公司股票进行投资。 | |
| 业绩比较基准 | 1 年期银行定期存款利率（税后）+3%（单利年化） | |
| 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。 | |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 景顺长城安享回报混合 A 类 | 景顺长城安享回报混合 C 类 |
| 下属分级基金的交易代码 | 001422 | 001423 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 450,939,265.93 份 | 125,106,446.31 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（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|----------------|
| | 景顺长城安享回报混合 A 类 | 景顺长城安享回报混合 C 类 |
| 1. 本期已实现收益 | 5,845,667.59 | 1,510,620.84 |
| 2. 本期利润 | 19,964,427.54 | 5,469,796.32 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0397 | 0.0388 |
| 4. 期末基金资产净值 | 661,858,993.69 | 180,616,572.08 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.468 | 1.444 |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

景顺长城安享回报混合 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 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|
| | | | | | | |

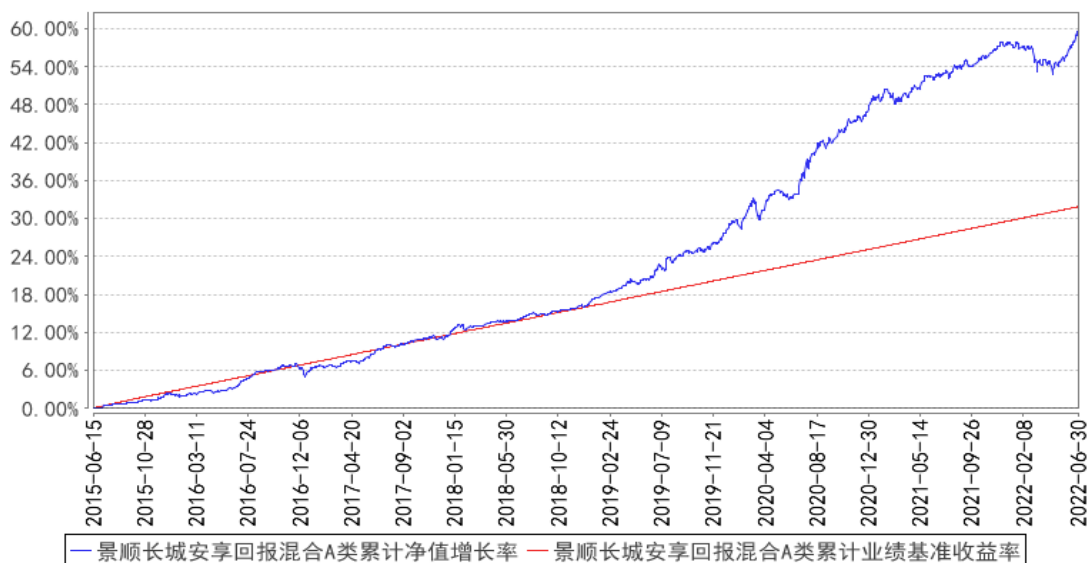
| | | | | ④ | | |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | 3.09% | 0.24% | 0.86% | 0.01% | 2.23% | 0.23% |
| 过去六个月 | 1.03% | 0.25% | 1.72% | 0.01% | -0.69% | 0.24% |
| 过去一年 | 4.48% | 0.20% | 3.53% | 0.01% | 0.95% | 0.19% |
| 过去三年 | 30.60% | 0.21% | 11.41% | 0.01% | 19.19% | 0.20% |
| 过去五年 | 45.84% | 0.18% | 20.57% | 0.01% | 25.27% | 0.17% |
| 自基金合同 生效起至今 | 59.55% | 0.15% | 31.86% | 0.01% | 27.69% | 0.14% |

景顺长城安享回报混合 C 类

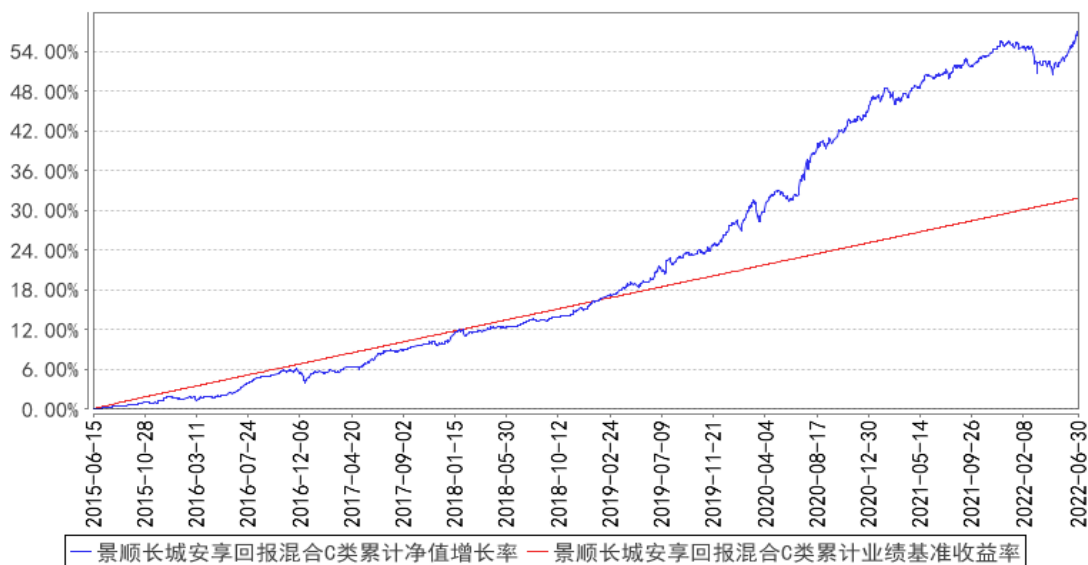
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准 差② | 业绩比较基准 收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 3.00% | 0.24% | 0.86% | 0.01% | 2.14% | 0.23% |
| 过去六个月 | 0.91% | 0.24% | 1.72% | 0.01% | -0.81% | 0.23% |
| 过去一年 | 4.26% | 0.20% | 3.53% | 0.01% | 0.73% | 0.19% |
| 过去三年 | 29.74% | 0.21% | 11.41% | 0.01% | 18.33% | 0.20% |
| 过去五年 | 44.97% | 0.18% | 20.57% | 0.01% | 24.40% | 0.17% |
| 自基金合同 生效起至今 | 57.01% | 0.16% | 31.86% | 0.01% | 25.15% | 0.15% |

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

景顺长城安享回报混合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图



景顺长城安享回报混合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。本基金的建仓期为自 2015 年 6 月 15 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 | | |
| 陈莹 | 本基金的基金经理 | 2020 年 7 月 25 日 | - | 8 年 | 工学硕士。曾任交通银行公司机构部高级行业经理, 浙商基金管理有限公司固定收益部信用评级研究员, 华安基金管理有限公司固定收益部信用分析师。2019 年 11 月加入本公司, 担任固定收益部信用研究员, 自 2020 年 7 月起担任固定收益部基金经理, 现任混合资产投资部基金经理。具有 8 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、《景顺长城安享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 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 10 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

海外经济方面，随着海外通胀数据超预期走高以及海外经济数据的全面走弱，市场对于美联储加快政策收紧以及经济“硬着陆”担忧开始加剧，股、债、商品市场均大幅波动。以原油为代表的大宗商品价格冲高回落，整体高位运行。10 年美债震荡上行 66bp，道琼斯工业指数下跌 11.25%。

国内方面，由于上海疫情的冲击，国内经济增长在二季度进一步下探，疫情对于经济的影响幅度大幅超此前市场预期。随着上海逐步复商复市，国内物流情况也得到了相对显著的恢复，企业生产逐步恢复正常，经济环比增长得到修复，从 5、6 月份的制造业 PMI 来看也验证了这一点。另一方面，近期卫健委、工信部均对疫情政策做出一定调整，后续即使再出现局部的疫情情况，预计对经济的冲击也将明显小于二季度。国内金融市场在二季度也较为动荡：股票市场一度在 4 月底较悲观，整体估值跌至历史底部区间，创业板指数更是从前期高点回撤超 30%。5 月以来股票市场开启反弹，上证指数和创业板指数均修复到今年 2 月左右的位置。受国内经济修复、海外通胀等因素影响，二季度中长端利率整体震荡上行，相较于 2022 年一季度末，5 年期国债上行 8BP 至 2.65%，10 年期国债上行 3BP 至 2.82%。

二季度组合债券部分采取杠杆套息策略，提高了杠杆水平并略微拉长了久期。权益部分以绝对收益为主要思路，整体提高了仓位，结构上以稳健低估值品种为主，加仓一部分中长期景气度较为确认的估值相对合理的成长品种。

展望未来，宏观场景判断短期内倾向于“稳货币、宽信用”。货币政策方面，目前在海外紧缩的背景下，国内政策利率调降的空间预计相对有限，但短期来看，银行间流动性预计仍将保持相对充裕。受益于银行间市场流动性的相对宽松，债券市场的中短端品种确定性相对较高，而长端品种市场仍在博弈后续经济复苏的幅度与动能，但随着后续房地产销售、财政、防疫政策等多方面的变化，长端品种的交易空间相对有限。

权益市场方面，整体持谨慎乐观看法。尽管稳增长政策在二季度受到了疫情反复的影响，我们仍对其后续效果的显现保持信心，并重点观察跟踪。6 月以来，我们看到了一些领域的政策加码，包括但不限于加大房企风险化解力度、房贷加权利率持续下行、部分区域购房政策松绑、多地消费券的发放、汽车购置税的减免等。部分高频经济指标也有所回暖。总体上看，国内经济修复仍在进行。货币政策在此过程中预计保持友好，央行近期也表态“继续从总量上发力以支持经济复苏”。同时，我们也认识到，国内疫情防控形式总体向好但任务仍然艰巨，阶段性海内外经

济周期分化和国际形势复杂严峻等因素使得国内经济修复不会一蹴而就，市场分析和预判难度仍大，下半年市场仍可能维持高波动。配置思路方面，寻找估值和景气度相匹配的板块，关注个股估值的安全边际，逢低吸纳代表消费升级及产业升级趋势的优质龙头。组合配置方向上，一方面，在中低估值的板块中寻找受益于宽信用、景气度边际改善或者有预期差的行业；另一方面，择机增配业绩确定性强的消费龙头以及估值合理的具备中长期景气度的优质成长品种。

债券市场方面，虽然目前债券收益率处于历史较低分位数，但考虑到当下经济周期以及货币政策的组合，债券仍然具备一定的配置价值。在货币市场资金面相对偏松背景下，组合适当利用杠杆策略增厚收益。配置方向依然以高等级信用债为主，继续立足票息策略，待收益率调整之后择机增配长债，同时积极把握赎回等流动性冲击带来的银行次级债的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2022 年 2 季度，景顺长城安享回报混合 A 类份额净值增长率为 3.09%，业绩比较基准收益率为 0.86%。

2022 年 2 季度，景顺长城安享回报混合 C 类份额净值增长率为 3.00%，业绩比较基准收益率为 0.86%。

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 | 170,759,441.46 | 16.91 |
| | 其中：股票 | 170,759,441.46 | 16.91 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 811,228,786.64 | 80.36 |
| | 其中：债券 | 811,228,786.64 | 80.36 |
| | 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 | 1,000,147.40 | 0.10 |
| | 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 | 9,022,637.48 | 0.89 |
| 8 | 其他资产 | 17,523,946.01 | 1.74 |
| 9 | 合计 | 1,009,534,958.99 | 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 | 166,062.00 | 0.02 |
| B | 采矿业 | 8,064,845.89 | 0.96 |
| C | 制造业 | 113,983,724.93 | 13.53 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,793,260.00 | 0.33 |
| E | 建筑业 | 85,631.00 | 0.01 |
| F | 批发和零售业 | 440,483.16 | 0.05 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,244,407.98 | 0.50 |
| H | 住宿和餐饮业 | 62,000.00 | 0.01 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,069,084.90 | 0.25 |
| J | 金融业 | 31,182,596.70 | 3.70 |
| K | 房地产业 | 2,131,895.00 | 0.25 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,703,831.00 | 0.20 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,659,453.93 | 0.32 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 24,378.42 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 581,371.55 | 0.07 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 566,415.00 | 0.07 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 170,759,441.46 | 20.27 |

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 | 306,650 | 10,981,136.50 | 1.30 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 4,800 | 9,816,000.00 | 1.17 |
| 3 | 002311 | 海大集团 | 83,086 | 4,985,990.86 | 0.59 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 114,748 | 4,842,365.60 | 0.57 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 79,900 | 4,825,161.00 | 0.57 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 23,800 | 4,805,934.00 | 0.57 |
| 7 | 300750 | 宁德时代 | 8,400 | 4,485,600.00 | 0.53 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 109,100 | 4,249,445.00 | 0.50 |
| 9 | 600741 | 华域汽车 | 132,900 | 3,056,700.00 | 0.36 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|--------------|------|
| 10 | 300760 | 迈瑞医疗 | 9,300 | 2,912,760.00 | 0.35 |
|----|--------|------|-------|--------------|------|

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 113,696,905.93 | 13.50 |
| | 其中：政策性金融债 | 51,465,369.86 | 6.11 |
| 4 | 企业债券 | 122,453,506.31 | 14.53 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 352,351,567.12 | 41.82 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,145,837.98 | 0.14 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 221,580,969.30 | 26.30 |
| 10 | 合计 | 811,228,786.64 | 96.29 |

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 | 2028024 | 20 中信银行二级 | 600,000 | 63,415,670.14 | 7.53 |
| 2 | 180204 | 18 国开 04 | 400,000 | 41,277,972.60 | 4.90 |
| 3 | 2028025 | 20 浦发银行二级 01 | 300,000 | 31,744,826.30 | 3.77 |
| 4 | 101759056 | 17 南通城建 MTN001 | 300,000 | 31,506,023.01 | 3.74 |
| 5 | 1928033 | 19 中国银行二级 03 | 300,000 | 31,500,713.42 | 3.74 |

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，以套期保值为目的，制定相应的投资策略：

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。

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。

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

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

中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”，股票代码：601998）因漏报抵押物价值 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据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，于 2022 年 3 月 21 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〔2022〕17 号），被处以 290 万元罚款。

2021 年 11 月 15 日，国家市场监督管理总局对福建百度博瑞网络科技有限公司与中信银行股份有限公司新设合营企业未依法申报违法实施经营者集中案作出行政处罚决定，出具行政处罚决定书（国市监处罚〔2021〕79 号），中信银行因违反《反垄断法》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中信银行进行了投资。

国家开发银行于 2022 年 3 月 21 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〔2022〕8 号）。其因未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据、漏报贸易融资业务 EAST 数据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，被处以罚款 440 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。

上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”，股票代码：600000）于 2021 年 7 月 13 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）27 号）。其因监管发现的问题屡查屡犯、配合现场检查不力、内部控制制度修订不及时等，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，被处以 6920 万元罚款。

2021 年 11 月 15 日，浦发银行因银行卡境外交易信息报送错误，违反了《中华人民共和国外汇管理条例》相关要求，被国家外汇管理局上海市分局（上海汇管罚字（2021）3121210802 号）处 6 万元人民币罚款。

2022 年 3 月 21 日，浦发银行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（2022）25 号），其因漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据、漏报贸易融资业务 EAST 数据等违法违规行为，被处以罚款人民币 420 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浦发银行进行了投资。

中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”，股票代码：601988, 3988.HK）于 2022 年 3 月 21 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（2022）13 号）。其因不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差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，被处以 480 万元罚款。

2022 年 5 月 26 日，中国银行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（2022）29 号）。其因老产品规模在部分时点出现反弹违法违规行为，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，被处以 200 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中国银行进行了投资。

宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”，股票代码：002142）于 2022 年 5 月 27 日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（2022）44 号）。其因非标投资业务管理不审慎、理财业务管理不规范、主承销债券管控不到位等，违反了《中华人民共和国银行业监督

管理法》第四十六条规定，被处以罚款人民币 290 万元。

2022 年 4 月 21 日，宁波银行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（2022）35 号）。其因薪酬管理不到位、关联交易管理不规范、绿色信贷政策执行不到位等，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条规定，被处以罚款人民币 270 万元。

2022 年 4 月 11 日，宁波银行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（2022）28 号）。其因信贷资金违规流入房地产领域、违规向土地储备项目提供融资等，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条规定，被处以罚款人民币 220 万元。同日，宁波银行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（2022）30 号）。其因代理保险销售不规范，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，被处以罚款人民币 30 万元。

2021 年 12 月 29 日，宁波银行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 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，违反了《中华人民共和国外汇管理条例》（2008 年国务院令第 532 号）第十二条及《国家外汇管理局综合司关于完善银行内保外贷外汇管理的通知》（汇综发（2017）108 号）第一条、第二条和第三条的相关规定，收到国家外汇管理局宁波市分局出具的行政处罚决定书（甬外管罚（2021）7 号），被予以责令改正，罚款 100 万元，没收违法所得 1048476.65 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。

2022 年 3 月 21 日，招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，股票代码：600036）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（2022）21 号），其因不

不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规行为，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招商银行进行了投资。

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 | 32,377.51 |
| 2 | 应收证券清算款 | 16,441,952.10 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,049,616.40 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 17,523,946.01 |

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 | 113516 | 苏农转债 | 613,059.60 | 0.07 |

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 | 景顺长城安享回报混合 A 类 | 景顺长城安享回报混合 C 类 |
|----------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 515,177,038.44 | 159,722,450.70 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 57,287,830.78 | 7,772,395.61 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 121,525,603.29 | 42,388,400.00 |

| | | |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 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 | 450,939,265.93 | 125,106,446.31 |

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

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享回报灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城安享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。

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 7 月 21 日