

景顺长城安鑫回报一年持有期混合型证券  
投资基金  
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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 10 月 26 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 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

## §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	173,421,710.52 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</p>

	<p>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> <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	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	143,005,134.87 份	30,416,575.65 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 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 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	-10,774,947.06	-1,974,644.94
2. 本期利润	-71,791.63	-3,531.66
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0003	-0.0001
4. 期末基金资产净值	150,642,933.74	31,884,363.96
5. 期末基金份额净值	1.0534	1.0482

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	0.41%	0.52%	0.85%	0.13%	-0.44%	0.39%
过去六个月	0.06%	0.40%	2.34%	0.12%	-2.28%	0.28%
过去一年	5.21%	0.38%	5.44%	0.13%	-0.23%	0.25%
自基金合同生效起至今	5.34%	0.34%	5.05%	0.13%	0.29%	0.21%

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	0.31%	0.52%	0.85%	0.13%	-0.54%	0.39%
过去六个月	-0.15%	0.40%	2.34%	0.12%	-2.49%	0.28%
过去一年	4.79%	0.38%	5.44%	0.13%	-0.65%	0.25%
自基金合同生效起至今	4.82%	0.34%	5.05%	0.13%	-0.23%	0.21%

### 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。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。报告期末距离建仓结束期未满一年。

### 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		
韩文强	本基金的基金经理	2020 年 7 月 10 日	-	12 年	管理学博士。曾任中国人寿资产管理有限公司基金投资部研究员、投资经理。2019 年 8 月加入本公司，自 2019 年 10 月起担任股票投资部基金经理，现任股票投资部总监、基金经理。具有 12 年证券、基金行业从业经验。
彭成军	本基金的基金经理	2020 年 9 月 12 日	-	14 年	理学硕士。曾任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、固定收益投资总监、基金经理。2019 年 5 月加入本公司，自 2020 年 9 月起担任固定收益部基金经理，现任固定收益部总经理、基金经理。具有 14 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

回顾上半年海内外的经济，从海外来说，海外正在复制中国此前的走势，在上一季度季报中我们认为 5 月份应当是海外经济修复的高点，此后将持续边际放缓，近几个月来的情况符合我们的预判，最新的 8 月全球制造业 PMI 跌至 54.1 新低、跌幅扩大，此前“虚高”的 7 月份非农就业数据在 8 月份也如期显露颓势，9 月继续低于市场预期，海外疫情的反复对于海外还是有显著影响，整体上看海外需求（特别是美国）后续仍面临着疫情、补贴停止、政府债务上限等因素的约束。而在最新 9 月份议息会议上，美联储进一步明确了 Taper 的节奏，整体基调偏鹰，Taper 时点与节奏可能略快于市场预期、加息时间点可能提前至 2022 年，最终政策的推演仍需要观察，最大的变数仍在于就业恢复的情况以及通胀的走势是否将显著超出政策制定者的预期。而如此前所提及的，美元指数的走高对于新兴市场而言仍是最大的不利因素，资本市场需要对此保持关注。国内方面，三季度以来的经济运行情况与我们的预判相一致，7、8 月份经济数据几乎全面低于预期，疫情与天气等因素有一定扰动，但趋势往下仍较为确定，对于经济趋势下行、逐步承压的判断没有改变。结构上看，工业生产继续降速，海外疫情扰动对于进出口仍有阶段性提振，投资方面房地产投资同比 8 月已经接近 0 增长、制造业投资同比持续下滑，基建投资同比维持负增长，消费实际增速 8 月已经跌至 0 附近，目前的经济状况与持续偏弱的货币金融数据等较为吻合，最新公布的 9 月制造业 PMI 再度低于市场预期并跌破荣枯线。此外，近来高炉、长丝等的开工率持续下降，能耗双控的影响仍在持续，若政策未出现边际变化，可以推演 9 月乃至之后的工业生产

大概率仍将偏弱，另一个影响是相关产品涨价。而从信用环境来看，预计 10 月份社融同比可能见到年内底部 10%左右，“宽信用”的实现目前仍较为渺茫，结合考虑明年稳杠杆以及经济增速的预测，预计社融增速趋势往下大概率还没结束。货币政策方面大体上维持了稳中偏松，宽松预期取决于是否可能在近期宣布降准，相应的时间窗口可能仅局限于 10 月份，目前来看这个概率在降低，国庆节之后央行公开市场操作较为谨慎。

三季度，本基金一直在合同约定范围内维持了一个较高的仓位，组合未做大的调整。宏观场景判断仍是“稳货币、紧信用”，但两者边际上都趋于缓和，目前来看股债都没有系统性风险，而从估值的角度来看，股票的性价比近来相对于债券有所抬升。信用收缩以及宏观经济基本面走弱的破局，有待房地产政策以及地方政府隐性债务约束的边际变化，后者目前仅在于 11 月前专项债发行完毕以及今年底明年初形成实物工作量，而前者的弹性相对更大，在“房住不炒”的大背景之下，近期部分城市房贷利率有所松动，近期中房协将召开房地产企业座谈，大的调控环境不会改变，但这些微妙的变化是否预示着政策的边际微调，这大概率是四季度与明年一季度经济走向的重要影响因素。

从股票市场的角度来说，今年涨幅领先的板块，钢铁、煤炭、有色等均为过去两年（2019 和 2020）整体表现落后且估值在历史底部的板块。在各种催化剂的作用下估值快速修复。进入四季度，我们目前持有的以地产为主的仓位，或将迎来估值修复的催化剂。债券策略方面，组合根据负债的变动，进行了持续的止盈兑现，降低组合债券持仓。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2021 年 3 季度，景顺长城安鑫回报混合 A 类份额净值增长率为 0.41%，业绩比较基准收益率为 0.85%。

2021 年 3 季度，景顺长城安鑫回报混合 C 类份额净值增长率为 0.31%，业绩比较基准收益率为 0.85%。

#### 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	52,492,875.87	28.52
	其中：股票	52,492,875.87	28.52
2	基金投资	-	-



3	固定收益投资	81,181,330.20	44.11
	其中：债券	81,181,330.20	44.11
	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	40,450,490.18	21.98
	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	6,516,820.93	3.54
8	其他资产	3,401,152.64	1.85
9	合计	184,042,669.82	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	10,103,892.85	5.54
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	18,324.07	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,521,139.55	6.86
J	金融业	9,259,518.00	5.07
K	房地产业	20,511,922.44	11.24
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	32,194.84	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	38,613.78	0.02
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	3,925.22	0.00
S	综合	-	-
	合计	52,492,875.87	28.76

### 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

### 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	002555	三七互娱	596,000	12,510,040.00	6.85
2	002867	周大生	452,701	9,031,384.95	4.95
3	000656	金科股份	1,692,809	8,734,894.44	4.79
4	600048	保利发展	455,600	6,392,068.00	3.50
5	600383	金地集团	480,800	5,384,960.00	2.95
6	601166	兴业银行	200,300	3,665,490.00	2.01
7	000001	平安银行	197,100	3,534,003.00	1.94
8	002966	苏州银行	302,500	2,060,025.00	1.13
9	688670	金迪克	2,310	199,029.60	0.11
10	688323	瑞华泰	4,513	129,252.32	0.07

### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,544,000.00	16.73
	其中：政策性金融债	30,544,000.00	16.73
4	企业债券	40,298,000.00	22.08
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	398,330.20	0.22
8	同业存单	9,941,000.00	5.45
9	其他	-	-
10	合计	81,181,330.20	44.48

### 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	150218	15 国开 18	200,000	20,538,000.00	11.25
2	152051	18 榕城 02	100,000	10,217,000.00	5.60
3	155252	19 中铁 04	100,000	10,055,000.00	5.51
4	155108	19 浦土 01	100,000	10,026,000.00	5.49
5	210206	21 国开 06	100,000	10,006,000.00	5.48

### 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、国家开发银行于 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)67号)。其因为违规的政府购买服务项目提供融资等多项违法违规行

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规定，被处以罚款 4880 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。

2、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。

2021 年 8 月 13 日，兴业银行因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，收到中国人民银行出具的行政处罚决定书（银罚字（2021）26 号），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。

3、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。

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。

4、苏州银行股份有限公司（以下简称“苏州银行”，股票代码：002966），于 2020 年 12 月 31 日收到中国银行保险监督管理委员会苏州监管分局出具的行政处罚决定书（苏州银保监罚决字（2020）48 号），其因差异化住房信贷政策执行不到位、个人经营性贷款资金用途管控不到位，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》，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苏州银行进行了投资。

5、其余六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	163,719.87
2	应收证券清算款	2,064,051.21
3	应收股利	-
4	应收利息	1,172,010.86
5	应收申购款	1,370.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,401,152.64

### 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	113044	大秦转债	357,712.80	0.20

### 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	688670	金迪克	199,029.60	0.11	新股流通受限
2	688323	瑞华泰	129,252.32	0.07	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	514,642,336.53	77,082,177.23
报告期期间基金总申购份额	888,803.68	568,271.47
减：报告期期间基金总赎回份额	372,526,005.34	47,233,873.05

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	143,005,134.87	30,416,575.65

## §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 10 月 27 日