

景顺长城品质成长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：招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。

基金托管人招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	景顺长城品质成长混合
基金主代码	008712
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 1 月 3 日
报告期末基金份额总额	1,246,948,568.75 份
投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。通过精选资产回报率高且兼具成长性的公司的股票，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>（一）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，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、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>（二）股票投资策略</p> <p>本基金通过定性与定量相结合的积极投资策略，精选资产回报率高且兼具成长性的公司的股票构建投资组合。</p> <p>（三）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>（四）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过分析宏观经济、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</p>

	<p>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>（五）股指期货投资策略</p> <p>本基金参与股指期货交易，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>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中证综合债券指数收益率*20%
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、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	招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	-5,550,513.78
2. 本期利润	-339,804,219.02
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2610
4. 期末基金资产净值	1,506,081,739.53
5. 期末基金份额净值	1.2078

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

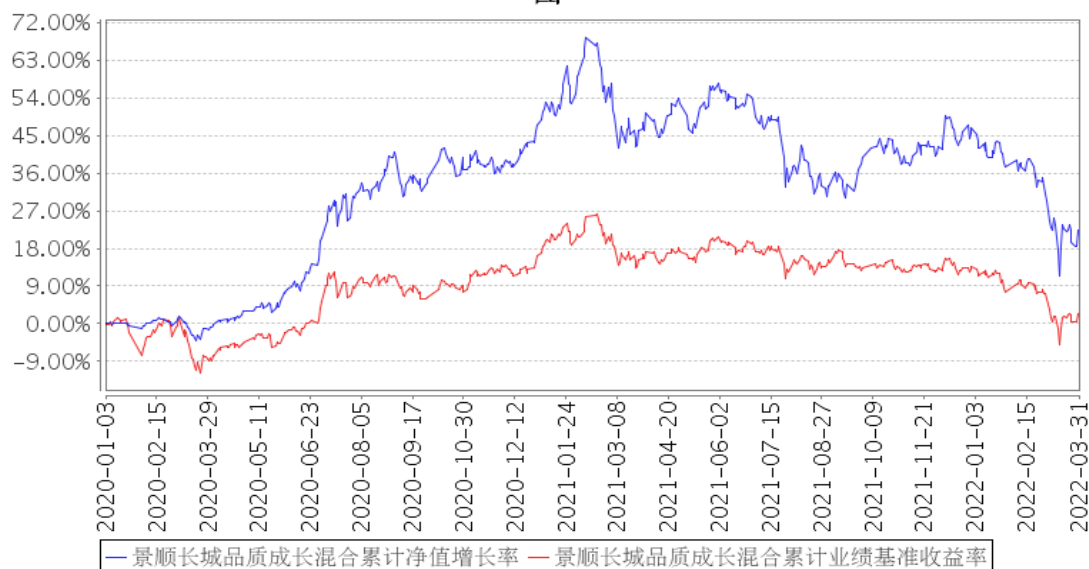
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 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	-17.69%	1.90%	-10.56%	1.27%	-7.13%	0.63%
过去六个月	-13.52%	1.56%	-10.45%	0.99%	-3.07%	0.57%
过去一年	-17.44%	1.47%	-12.17%	0.90%	-5.27%	0.57%
自基金合同 生效起至今	20.78%	1.34%	1.56%	1.03%	19.22%	0.31%

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

景顺长城品质成长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：基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 60%~95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%），投资于本基金界定的“品质成长”主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金投资于同业存单比例不超过基金资产的 20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自 2020 年 1 月 3 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		
刘苏	本基金的基金经理	2020 年 1 月 3 日	-	17 年	理学硕士, CFA。曾任深圳国际信托投资有限公司（现华润深国投信托）信托业务部信托经理, 鹏华基金基金管理部高级研究员、基金经理助理、基金经理。2015 年 5 月加入本公司, 自 2015 年 9 月起担任股票投资部基金经理, 并曾任研究部副总经理, 现任研究部总经理、股票投资部基金经理。具有 17 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、《景顺长城品质成长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

2022 年一季度，A 股市场再次出现较为明显的行业分化。与稳增长相关的地产、建筑建材、银行及部分资源行业表现相对较好，有正收益，而其它大部分行业表现较差，其中去年表现相对突出的半导体、新能源板块和外资配置较多的消费、医疗板块普遍表现落后。经济层面，国内疫情再次出现反复，对实体经济带来负面冲击。而政府稳增长的力度相对有限，主要的下游需求如地产、汽车、消费整体依然较为疲弱。外部环境上，俄乌战争引发了新一轮的“逆全球化”的舆论导向，经济制裁与观念的冲突造成了实质性的经济层面割裂，部分上游大宗商品持续涨价，经济滞胀的担忧开始加剧。药明生物被美国商务部列入“未经证实名单”造成投资人对于中国在先进制造领域出口竞争力的担忧；由于未能提交审计底稿，按照美国《外国公司问责法》，在美上市的中概股可能存在被强制退市的风险……在全球政治不稳定、经济预期不佳、资本市场大幅波动的背景下，短期全球资金从中国资产撤离的迹象非常明显，包括海外中概股、港股、A 股绩优蓝筹等外资持仓相对多的领域，整体表现都比较差。由于我们长期坚持投资高质量公司，因此阶段性组合受拖累较大。从整个季度来看，基金管理人整体投资思路没有太多变化，依然坚持“买股票就是买企业”的思路，聚焦在自己熟悉的好生意中，同时根据股价的波动，适当进行调整，不停优化组合的风险收益比，我们尤其重视那些由于短期或暂时性因素导致业绩、股价表现较差的优质资产，并进行了适当的增配。我们始终坚信，无论市场短期如何波动，优质公司的股权长期看一定是最有价值的资产。

尽管判断市场非常困难，但我们依然会用企业盈利增长趋势、资金成本变动方向、政策导向和市场估值水平这几个因素去大致判断市场趋势。结合我们目前掌握的数据，展望下一阶段，首先我们判断企业整体盈利在未来的 1-2 个季度大概率增速仍是持续下行的，下游的疲弱和上游原材料价格的坚挺，会让很多中游企业承担较大的盈利压力，产业链上少数成本不敏感或者具备提价权的环节盈利存在改善的可能。另外从需求变化的角度，我们认为后续稳增长的力度会继续加大，地产链上部分环节需求增长的确性较强。其次从流动性角度看，在中央经济工作会议释放出稳增长信号后，央行货币政策执行报告也删除了“货币总闸门”的措辞，这意味着接下来一段时间社会融资规模增速会有所反弹，这将保障市场流动性不会过于紧缩。尽管海外流动性在不断收紧，但我们认为国内将保持货币政策的独立性。因此流动性不会成为制约今年资本市场表现的

主要因素。第三，从估值角度看，市场整体估值已经回落到历史平均水平之下，股票资产相对于债券资产的吸引力也处于历史上相对比较高的位置。市场上已经出现了大批长期性价比不错，隐含回报率较高的品种，甚至包括一些消费、服务行业的“核心资产”，而部分新兴产业的优质公司伴随过去几个月的调整之后，长期投资价值也有所显现。在政策角度，我们坚持上一期的判断：各项针对产业的整顿政策和各种紧缩性政策已经渡过密集出台期，进入政策效果观察期。综合以上四点，我们觉得 A 股市场目前整体上看不到大的风险，但仍以结构性行情为主。市场出现趋势性行情的前提是市场对于未来经济增长和企业盈利重拾信心，且内外部环境相对平稳，目前我们只能耐心等待这样的时间窗口。而港股市场恒生指数已经跌回到 2009 年的水平，尽管短期市场走势很难判断，但从大周期的角度，港股整体处于低估值状态。

过去几年，基金管理人始终坚持并不断完善“好行业、好企业、好时机”相结合的投资理念，我们希望找到那些商业模式优、行业壁垒深、投资赔率高、企业管理好的投资标的。在过去一段时间，我们花了较多的精力去研究和思考市场关注度比较高的新能源、半导体等“硬科技”领域，希望能够纳入到我们已有的投资体系中，因为在之前的投资过程中，我们出于“不确定性高”的原因，对这些新兴领域相对较为谨慎，我们主要担心技术路线更新迭代的不确定性、行业竞争格局的不确定性、利润在产业链上不同环节分配的不确定性、企业竞争优势的不确定性等等。毕竟我们投资理念的出发点还是站在 DCF 的视角去选出那些确定性较强的内在价值越来越大的企业，避免投资短期景气高但长期价值不大的企业。这些担忧始终会存在，但我们也发现作为新时代的“基础设施”，部分环节具备了技术路线演进相对缓慢、产品生命周期长、行业竞争格局相对稳定、优势企业具备积累效应的特点。由于这些新兴行业本质上都是制造业，不存在显著的进入门槛，因此产业链各环节普遍呈现经营的周期性，符合我们刚才所提到的特点的部分行业，有机会诞生我们所要求的那类内在价值中枢不断提升的周期成长股，这是与我们现有投资理念相匹配的，我们也会在合适的时机纳入我们的组合。最后还是强调一下我们的选股偏好，在具备较好赔率的前提下，我们将聚焦于三类公司：第一类，产品或服务难被替代且有定价权的公司（好行业）；第二类，虽然业务存在替代品和竞争但已被证明存在显著竞争优势且竞争优势能够维持或持续加强的公司（好企业）；第三类，处于周期底部且估值预期较低的成本领先型公司（针对周期成长股的好时机）。

在不确定性加大的时期，我们希望通过长期逻辑的确定性（商业模式、行业格局、企业竞争力）而非仅仅是短期业绩的确定性（景气），来获取长期投资的回报。

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-17.69%，业绩比较基准收益率为-10.56%。

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	1,366,724,140.58	90.25
	其中：股票	1,366,724,140.58	90.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	592,961.79	0.04
	其中：债券	592,961.79	0.04
	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	146,624,561.23	9.68
8	其他资产	439,091.09	0.03
9	合计	1,514,380,754.69	100.00

注：1、权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 314,196,143.00 元，占基金资产净值的比例为 20.86%。

2、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	20,504,988.00	1.36
C	制造业	735,031,941.96	48.80
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	330,698.62	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	7,603.20	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,857,691.09	0.52
J	金融业	101,707,193.69	6.75
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	93,264,211.77	6.19
M	科学研究和技术服务业	58,955,722.98	3.91
N	水利、环境和公共设施管理业	21,551.15	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	34,839,285.00	2.31
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,052,527,997.58	69.89

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	17,619,224.69	1.17
非周期性消费品	85,111,579.40	5.65
综合	-	-
能源	1,534,936.68	0.10
金融	78,149,699.74	5.19
工业	2,899,685.15	0.19
信息技术	-	-
公用事业	-	-
通讯	128,881,017.34	8.56
合计	314,196,143.00	20.86

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

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	72,589	124,780,491.00	8.29
2	000858	五粮液	753,824	116,887,949.44	7.76
3	002142	宁波银行	2,720,171	101,707,193.69	6.75
4	300630	普利制药	2,180,107	94,725,649.15	6.29
5	00700	腾讯控股	300,434	91,175,692.89	6.05
6	000568	泸州老窖	418,500	77,790,780.00	5.17
7	01109	华润置地	2,247,258	66,523,027.94	4.42
8	601888	中国中免	383,863	63,095,561.31	4.19
9	603259	药明康德	514,218	57,787,818.84	3.84
10	002271	东方雨虹	1,208,167	54,295,024.98	3.61

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	592,961.79	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	592,961.79	0.04

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	118005	天奈转债	4,700	592,961.79	0.04

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，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

本基金可投资国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

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、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，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。

2、2021 年 7 月 6 日，腾讯控股（以下简称“腾讯控股”，股票代码：00700.HK）因违法实施的经营者集中，但不具有排除、限制竞争的效果，收到市场监管总局的行政处罚决定书（国市监处〔2021〕59 号、国市监处〔2021〕61 号、国市监处〔2021〕65 号），分别被处以罚款人民币 50 万元，共计 150 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腾讯控股进行了投资。

3、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。

4、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	189,521.37
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	249,569.72
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	439,091.09

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	1,340,820,752.38
报告期期间基金总申购份额	16,378,105.88
减：报告期期间基金总赎回份额	110,250,289.51
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	1,246,948,568.75

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品质成长混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城品质成长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城品质成长混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城品质成长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