

景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券型证  
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	6,812,602,153.24 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	3,074,150,640.73 份	3,738,451,512.51 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 1 月 1 日-2022 年 3 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	9,198,704.74	8,552,768.02
2. 本期利润	-33,535,922.40	-48,037,488.41
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0142	-0.0153
4. 期末基金资产净值	3,447,725,128.97	4,161,631,684.24
5. 期末基金份额净值	1.1215	1.1131

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	①-③	②-④

				④		
过去三个月	-1.05%	0.30%	-0.83%	0.16%	-0.22%	0.14%
过去六个月	0.16%	0.23%	0.46%	0.13%	-0.30%	0.10%
过去一年	6.04%	0.20%	2.81%	0.12%	3.23%	0.08%
自基金合同生效起至今	12.15%	0.23%	6.60%	0.13%	5.55%	0.10%

景顺长城景颐嘉利6个月持有期债券C类

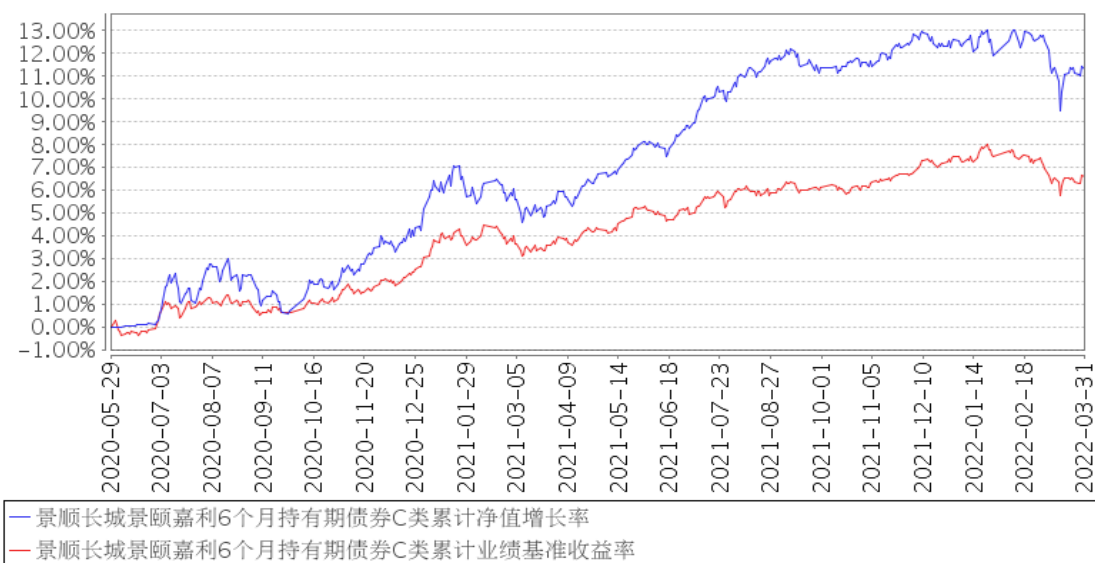
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.15%	0.30%	-0.83%	0.16%	-0.32%	0.14%
过去六个月	-0.07%	0.23%	0.46%	0.13%	-0.53%	0.10%
过去一年	5.60%	0.20%	2.81%	0.12%	2.79%	0.08%
自基金合同生效起至今	11.31%	0.23%	6.60%	0.13%	4.71%	0.10%

### 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	-	22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22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	-	16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16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	-	16 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 16 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	-	7 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 7 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 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 年一季度海内外宏观环境非常动荡，对资本市场影响很大：从海外情况来看，先有美国通胀压力持续，美债收益率开年就大幅反弹，对资本市场流动性有较大冲击；进入 2 月份，俄乌冲突意外爆发，大宗商品价格暴涨，市场对滞胀的担忧再起；进入 3 月份以后，先有深圳上海疫情进一步扩大，后有中概股可能退市的冲击，资本市场表现更为动荡。3 月 16 日，金融稳定委员会发声，就市场关心的稳增长、房地产企业风险化解、中概股以及大型平台企业等问题都给予积极回应，市场信心得以大力恢复。而就已经公布的经济数据来看，受疫情的冲击，整体需求较为一般，尤其 2 月份的社融数据较为疲软，其中和房贷高度相关的居民中长期贷款较为罕见的出现单月负增长。

债券市场在一季度呈现震荡走势，收益率先下后上：年初资金面较为宽松，收益率出现一定幅度下行，而进入 2 月份以后，随着股票市场调整，由于基金赎回压力导致债券也被抛售，债市收益率出现一定上行。整体来看，一季度末利率债收益率整体和年初相比有小幅下行，5 年的利率债有所上行。1 年期信用债收益率下行约 10bp，而 3 年和 5 年收益率有所上行，信用债曲线有所陡峭。

受前述各种事件冲击的影响，一季度股票市场震荡下行，进入 3 月份，股票市场下行加速，在金融稳定委员会讲话后，股票市场企稳并有一定幅度回升。从股市风格来看，估值相对较高的个股大幅下挫而受益于商品价格上涨的周期股以及估值较合理的价值股表现较好。上证指数当季下跌 10.65%、沪深 300 下跌 14.53%、创业板指下跌 19.96%。

一季度本基金小幅增加了对中短久期高等级信用债配置，债券组合结构微调。对于股票组合我们保持了合同约定中性偏高的配置，结构上进一步向前期跌幅较大、估值较为合理的金融股和消费股、估值较为便宜的周期股，以及预期未来景气程度将见底回升的交运板块、地产板块等板块集中。

经历了惊心动魄的一季度，在政策开始逐步发力的背景下，近期股票市场情绪在逐步回暖，我们预计一季度影响市场的一些外部因素，短期都很难再进一步恶化，未来有望出现改善。我们将重点聚焦国内稳增长的手段，并密切跟踪。从中央政府一直以来的态度来看，稳增长应该是逐步发力的过程，而地产政策是焦点。近期各地地方政府也因城施策，陆续出台稳定房地产市场的措施，中国宏观经济底部逐步企稳的概率很大。因此，我们将继续保持偏高的股票持仓，方向上继续偏向于受益于国内稳增长政策、景气程度向好的行业和个股。未来我们会更灵活一点，从仓位到结构都进行积极操作。

对于债券市场，我们预计短期仍维持震荡，较难有超额收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2022 年 1 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-1.05%，业绩比较基准收益率为-0.83%。

2022 年 1 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-1.15%，业绩比较基准收益率为-0.83%。

#### 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	1,216,846,428.24	15.82
	其中：股票	1,216,846,428.24	15.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,207,516,916.27	80.69
	其中：债券	6,207,516,916.27	80.69
	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	119,932,485.84	1.56
	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	121,009,333.97	1.57
8	其他资产	27,561,465.35	0.36
9	合计	7,692,866,629.67	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	20,850,942.00	0.27
B	采矿业	262,844,033.43	3.45
C	制造业	613,862,920.97	8.07
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,047,419.00	0.13
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	270,006,755.84	3.55
K	房地产业	18,047,064.00	0.24
L	租赁和商务服务业	21,187,293.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	1,216,846,428.24	15.99

### 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	000001	平安银行	5,607,083	86,236,936.54	1.13
2	601166	兴业银行	3,678,400	76,032,528.00	1.00
3	601857	中国石油	12,025,800	66,382,416.00	0.87
4	601899	紫金矿业	5,560,050	63,050,967.00	0.83
5	600519	贵州茅台	32,500	55,867,500.00	0.73
6	601225	陕西煤业	3,148,800	51,797,760.00	0.68
7	000776	广发证券	2,916,535	51,272,685.30	0.67

8	000568	泸州老窖	243,726	45,303,788.88	0.60
9	000792	盐湖股份	1,299,700	39,081,979.00	0.51
10	600988	赤峰黄金	2,050,811	37,181,203.43	0.49

#### 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	114,981,181.05	1.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,177,239,460.28	15.47
	其中：政策性金融债	1,177,239,460.28	15.47
4	企业债券	1,114,596,812.07	14.65
5	企业短期融资券	976,710,092.06	12.84
6	中期票据	1,623,895,774.29	21.34
7	可转债（可交换债）	722,144,130.23	9.49
8	同业存单	-	-
9	其他	477,949,466.29	6.28
10	合计	6,207,516,916.27	81.58

#### 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	371,833,643.84	4.89
2	200203	20 国开 03	2,100,000	214,760,268.49	2.82
3	113052	兴业转债	1,410,160	155,105,816.48	2.04
4	210202	21 国开 02	1,500,000	152,276,465.75	2.00
5	113044	大秦转债	1,291,320	140,325,621.68	1.84

#### 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、2021 年 5 月 28 日，平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”，股票代码：000001）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。

2022 年 3 月 21 日，平安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〕24 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 数据存在偏差等违法违规事实，被处以罚款人民币 400 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。

2、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。

3、青海盐湖工业股份有限公司（以下简称“盐湖股份”，股票代码：000792）于 2021 年 9 月 28 日收到国家市场监督管理总局出具的行政处罚决定书（市监处罚【2021】71 号），其因在生产成本未发生显著变化的情况下，大幅度上调销售价格，违反了《中华人民共和国价格法》第十四条第（三）项的规定，被处以 160 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盐湖股份进行了投资。

4、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。

兴业银行于 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）22 号），其因漏报贸易融资业务 EAST 数据、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 350 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。

5、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。

### 5.10.2 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	737,854.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	26,823,610.41
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	27,561,465.35

### 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	113044	大秦转债	140,325,621.68	1.84
2	132015	18 中油 EB	114,707,632.07	1.51
3	110053	苏银转债	70,130,746.06	0.92
4	113011	光大转债	67,391,137.11	0.89
5	132009	17 中油 EB	55,484,371.04	0.73
6	110073	国投转债	13,626,466.20	0.18
7	113563	柳药转债	11,196,685.20	0.15
8	113042	上银转债	11,045,436.81	0.15
9	123119	康泰转 2	10,799,732.49	0.14
10	128135	洽洽转债	8,792,998.52	0.12
11	127018	本钢转债	6,111,309.65	0.08
12	127039	北港转债	5,249,466.44	0.07
13	127020	中金转债	5,006,932.91	0.07
14	113037	紫银转债	4,428,212.73	0.06
15	113615	金诚转债	3,932,342.01	0.05
16	113629	泉峰转债	3,251,973.08	0.04
17	123107	温氏转债	2,941,737.78	0.04
18	113047	旗滨转债	1,559,873.79	0.02
19	113619	世运转债	1,149,278.02	0.02
20	128129	青农转债	811,001.44	0.01
21	113033	利群转债	732,144.00	0.01
22	113048	晶科转债	692,917.97	0.01
23	128136	立讯转债	595,695.17	0.01
24	110079	杭银转债	545,003.20	0.01
25	132018	G 三峡 EB1	521,582.06	0.01
26	128029	太阳转债	495,393.49	0.01
27	128097	奥佳转债	485,624.72	0.01
28	128048	张行转债	404,918.91	0.01
29	110081	闻泰转债	255,904.14	0.00
30	113050	南银转债	243,570.13	0.00
31	110048	福能转债	132,598.37	0.00
32	128123	国光转债	33,628.95	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

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

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	1,836,262,636.03	2,450,382,057.52
报告期期间基金总申购份额	1,588,014,611.54	1,294,303,349.45
减:报告期期间基金总赎回份额	350,126,606.84	6,233,894.46
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	3,074,150,640.73	3,738,451,512.51

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 4 月 22 日