

景顺长城品质成长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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	1,208,954,332.99 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>本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以</p>

	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。	
	（五）股指期货投资策略 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。	
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	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。 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。	
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	
下属分级基金的基金简称	景顺长城品质成长混合 A	景顺长城品质成长混合 C
下属分级基金的交易代码	008712	015775
报告期末下属分级基金的份额总额	1,208,867,005.82 份	87,327.17 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)	报告期(2022年5月26日-2022年6月30日)
	景顺长城品质成长混合 A	景顺长城品质成长混合 C
1. 本期已实现收益	-50,577,506.52	-1,115.33
2. 本期利润	128,025,813.40	8,068.72
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1040	0.1490
4. 期末基金资产净值	1,588,442,139.99	114,583.75
5. 期末基金份额净值	1.3139	1.3121

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、本基金自 2022 年 5 月 25 日起增设 C 类基金份额，并于 2022 年 5 月 26 日开始对 C 类份额进行估值。

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

景顺长城品质成长混合 A

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	8.78%	1.64%	4.55%	1.14%	4.23%	0.50%
过去六个月	-10.45%	1.79%	-6.48%	1.21%	-3.97%	0.58%
过去一年	-14.53%	1.59%	-11.03%	1.01%	-3.50%	0.58%
自基金合同生效起至今	31.39%	1.37%	6.19%	1.04%	25.20%	0.33%

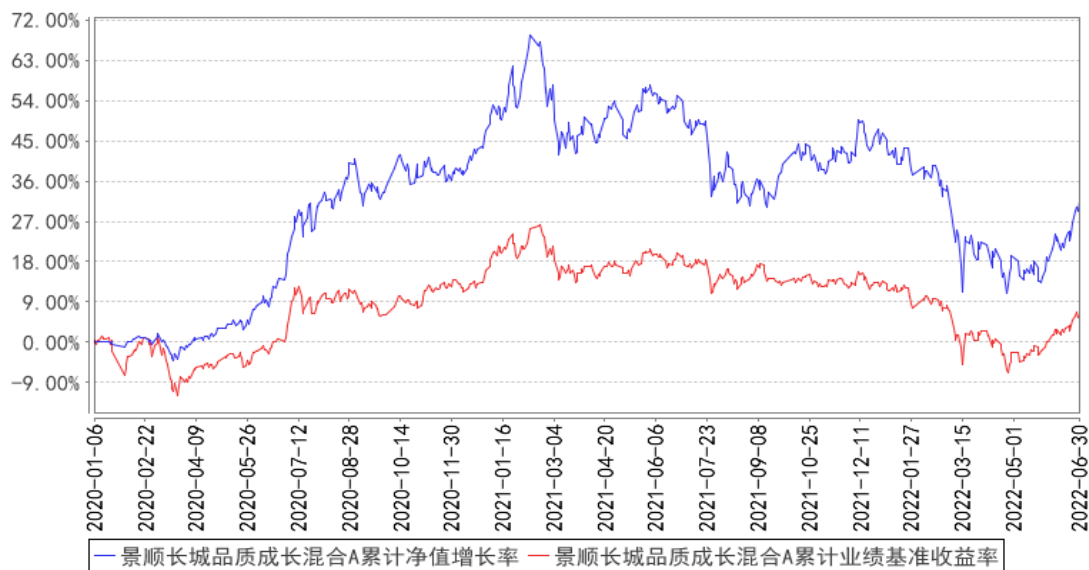
景顺长城品质成长混合 C

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
自基金合同生效起至今	15.42%	1.31%	8.85%	0.80%	6.57%	0.51%

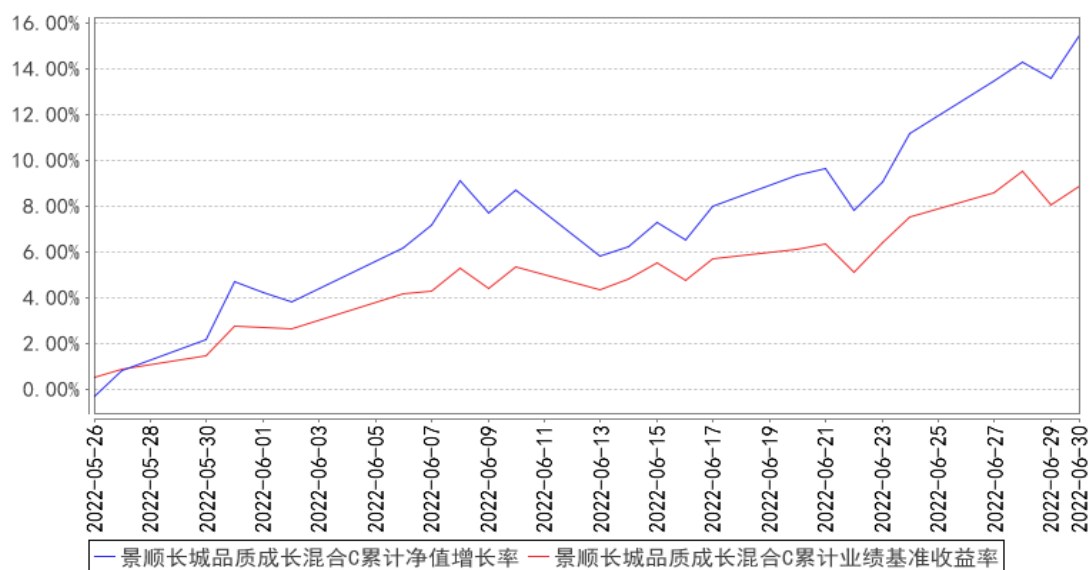
注：本基金自 2022 年 5 月 25 日起增设 C 类基金份额，并于 2022 年 5 月 26 日开始对 C 类份额进行估值。

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A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



景顺长城品质成长混合C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。本基金自2022年5月25日起增设C类基金份额。

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遵规守信情况的说明

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 第 6 页 共 16 页

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

2022 年二季度，股票市场呈现比较大的波动，4 月份市场一直处于低迷状态，上证指数跌破 3000 点，但是 4 月底市场阶段性见底后，整体出现了较为明显的反弹。5 月份以来的反弹中率先有所表现，且涨幅相对突出的，恰是前 4 个月表现相对较差的新能源板块，不少个股反弹幅度巨大。进入 6 月份后，伴随全国主要地区疫情得到控制，市场信心逐步恢复，一些消费、服务等行业也开始补涨。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”的长期思路，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。考虑到 3、4 月份市场低迷的情况下，从长期看很多优质公司的估值已经非常有吸引力，因此我们保持了合同约定较高的股票仓位。我们始终坚信，无论市场短期如何波动，长期看优质公司的股权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 个季度环比将有所改善，一方面是 2 季度的疫情对经济拖累较为严重，企业盈利增速出现了较为异常的负向冲击，形成了一个相对比较低的基数，另一方面，政府也进一步的加强了对经济的支持力度，各类刺激消费的政策陆续出台，房地产销售也在前几个月大幅下降之后，出现了环比的企稳。但是我们目前认为经济复苏的力度还不是非常强劲，或许后续政策仍有加码的空间。其次从流动性角度看，上个季度我们对流动性相对比较乐观，因为当时受疫情影响，经济受影响较大，但是这个季度我们会比之前略有一些谨慎，原因一是海外通胀居高不下，全球主要经济体持续加息，制约了国内货币进一步放松进而利率继续下行的空间，二是经济指标的企稳回升，也制约了收益率继续向下的空间。第三，从估值角度看，经过快速反弹后，市场整体估值已经回到历史平均水平之上，部分热门板块的估值甚至又回到了历史相对高的位置。伴随估值的回升，这些公司股票的短期性价比也有所下降，需要时间来消化估值。但市

场整体估值水平仍不是很贵，市场上依然存在一批长期性价比不错，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”，以及部分预期较为悲观的传统行业公司。在政策角度，我们相对乐观一些，在经济增长尚未完全恢复的情况下，政策导向还是以稳为主，对宏观经济和产业发展更多是支持的导向。综合以上四点，我们觉得 A 股市场未来一段时间可能会呈现震荡格局，仍需要精选个股来应对市场波动。

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，这种投资理念的出发点是站在 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，而避免投资短期景气高但长期价值不大的企业。为了匹配我们的投资理念，我们持续在寻找那些商业模式优、行业壁垒深、增长潜力大、企业管理好的投资标的，同时需要在我们认为合理的估值水平下进行投资。在过去一段时间内，我们进一步完善更新了能力圈范围内公司的价值评估，我们希望进一步完善我们在投资决策时买入、卖出的标准和流程，避免好的公司买的太贵，导致长期回报不足。在我们看来，真正的风险一是买错了品种，亏损卖出，出现本金永久性亏损，第二就是好的标的买的太贵，导致长期回报不足。另外，针对今年在煤炭行业投资仓位较轻，我们也做了反思。按照之前投资周期股的思路，我们不太愿意在盈利周期高位去对这些景气行业进行投资，因为在盈利高位时，理论上资本是会大量进入这样的行业，最终导致供给增加，行业盈利下降。我们更希望在行业盈利底部，去寻找那些竞争优势依然存在，但市场预期已经比较低的投资机会。但是供给侧改革、“双碳”的政策要求，以及煤企对未来煤炭需求和煤价相对悲观，共同导致煤炭行业的资本周期被打断，供给很难短期内快速增加，煤价有可能长期维持在相对高的位置。尽管政府对大量的煤企采取“限价”（长协）的措施，但即使在煤价受限的情况下，大量企业在年初从现金流的视角，基本上股东未来获取的现金流能在较短时间内将整个企业买下并偿还掉所有有息负债。这种公司从收入端考虑，量和价都不见得有很大的增长潜力，但绝对估值足够便宜，依然是好的投资机会。我们之前对于收入增长潜力小、内在价值无法持续较快速提升的机会关注的少，但今年煤炭行业的表现让我们反思我们看待周期股的方法仍有较大的改善空间，我们也将此类投资机会纳入到我们的选股标准中。

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，我们将聚焦于四类公司：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）；第四类，那些站在现金流视角能以较短时间回本的投资机会（针对低估值低增速企业的好时机）。

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、估值)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 2 季度,景顺长城品质成长混合 A 类份额净值增长率为 8.78%,业绩比较基准收益率为 4.55%。

2022 年 5 月 26 日(C 类份额首个估值日)至本报告期末,景顺长城品质成长混合 C 类份额净值增长率为 15.42%,业绩比较基准收益率为 8.85%。

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	1,467,834,863.24	91.57
	其中:股票	1,467,834,863.24	91.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	670,229.01	0.04
	其中:债券	670,229.01	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	127,271,773.59	7.94
8	其他资产	7,180,577.49	0.45
9	合计	1,602,957,443.33	100.00

注:权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 345,919,473.84 元,占基金资产净值的比例为 21.78%。

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	47,411,580.25	2.98
C	制造业	788,185,891.94	49.62

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	36,292.74	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	590,477.88	0.04
J	金融业	87,669,003.51	5.52
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	111,905,089.37	7.04
M	科学研究和技术服务业	49,517,259.69	3.12
N	水利、环境和公共设施管理业	43,132.47	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	36,556,661.55	2.30
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,121,915,389.40	70.62

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	32,783,268.22	2.06
非周期性消费品	72,298,239.45	4.55
综合	-	-
能源	3,003,836.85	0.19
金融	95,970,484.63	6.04
基金	-	-
工业	20,723,648.23	1.30
信息技术	-	-
公用事业	-	-
通讯	121,139,996.46	7.63
合计	345,919,473.84	21.78

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	68,789	140,673,505.00	8.86
2	000858	五粮液	671,424	135,580,648.32	8.53
3	000568	泸州老窖	396,800	97,827,072.00	6.16
4	002142	宁波银行	2,448,171	87,669,003.51	5.52
5	601888	中国中免	337,763	78,675,135.59	4.95

6	00700	腾讯控股	249,534	75,628,599.03	4.76
7	01109	华润置地	2,045,258	64,016,481.32	4.03
8	300630	普利制药	1,580,607	55,558,336.05	3.50
9	002271	东方雨虹	1,031,467	53,089,606.49	3.34
10	002475	立讯精密	1,497,080	50,586,333.20	3.18

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）	670,229.01	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	670,229.01	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	670,229.01	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

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。

2021 年 7 月 6 日,腾讯控股有限公司(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。

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	170,116.04
2	应收证券清算款	4,585,703.88
3	应收股利	2,217,495.08
4	应收利息	-
5	应收申购款	207,262.49
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,180,577.49

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

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城品质成长混合 A	景顺长城品质成长混合 C
报告期期初基金份额总额	1,246,948,568.75	-
报告期期间基金总申购份额	16,028,398.54	87,335.23
减：报告期期间基金总赎回份额	54,109,961.47	8.06
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	1,208,867,005.82	87,327.17

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

为了更好地满足投资者的理财需求，根据《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》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》等法律法规的规定和《景顺长城品质成长混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2022 年 5 月 25 日起对景顺长城品质成长混合型证券投资基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额，同时对《基金合同》和《景顺长城品质成长混合型证券投资基金托管协议》进行了相应的修改。详情请参阅本基金管理人于 2022 年 5 月 24 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城品质成长混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告》。

§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 7 月 21 日