

景顺长城顺鑫回报混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 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 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城顺鑫回报混合
基金主代码	010211
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 9 月 29 日
报告期末基金份额总额	753,650,309.62 份
投资目标	在严格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</p>

	<p>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。</p> <p>4、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，在高景气行业中筛选出价值优势明显的优质股票进行均衡配置，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。</p> <p>5、股指期货投资策略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。</p>
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80% + 沪深 300 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。
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	景顺长城顺鑫回报混合 A 类 景顺长城顺鑫回报混合 C 类
下属分级基金的交易代码	010211 010212
报告期末下属分级基金的份额总额	411,765,752.79 份 341,884,556.83 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 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）	
	景顺长城顺鑫回报混合 A 类	景顺长城顺鑫回报混合 C 类
1. 本期已实现收益	7,006,494.56	5,740,389.59

2. 本期利润	-5,855,218.23	-5,152,518.74
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0136	-0.0141
4. 期末基金资产净值	453,296,396.40	375,110,260.28
5. 期末基金份额净值	1.1008	1.0971

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

景顺长城顺鑫回报混合 A 类

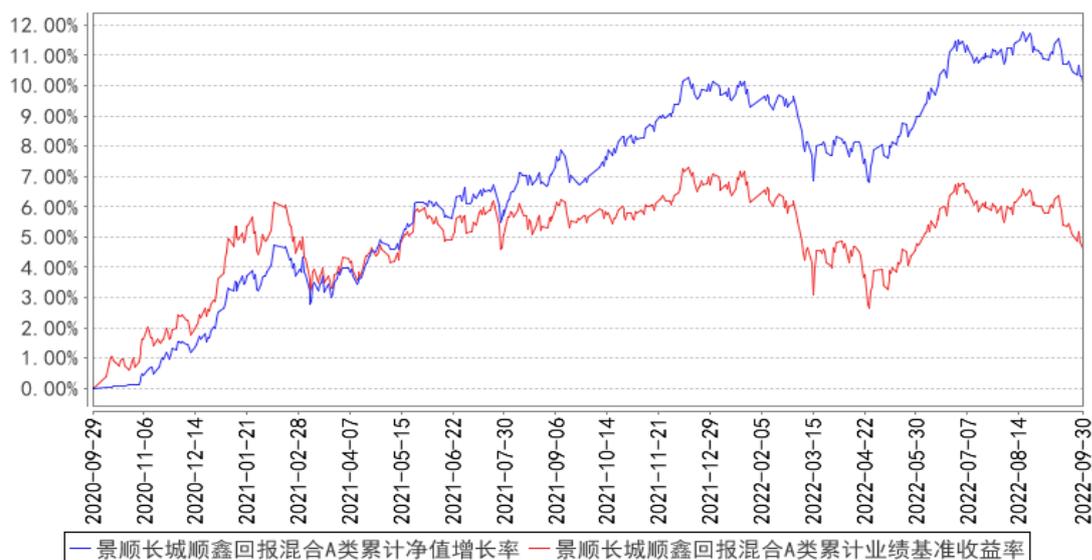
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.27%	0.17%	-2.02%	0.18%	0.75%	-0.01%
过去六个月	1.87%	0.20%	0.10%	0.23%	1.77%	-0.03%
过去一年	2.88%	0.20%	-1.00%	0.24%	3.88%	-0.04%
自基金合同生效起至今	10.08%	0.19%	4.60%	0.24%	5.48%	-0.05%

景顺长城顺鑫回报混合 C 类

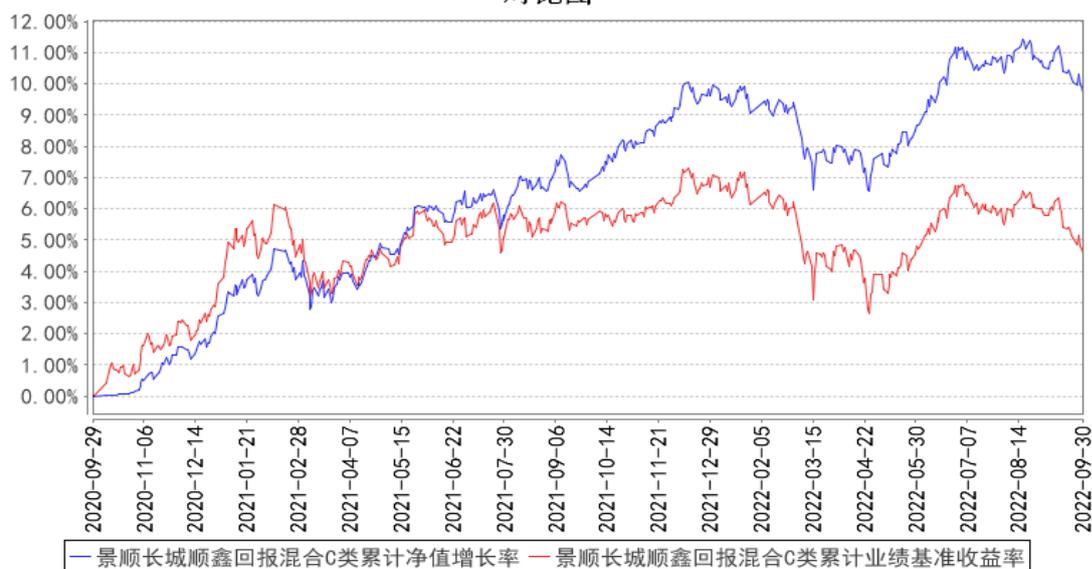
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.32%	0.17%	-2.02%	0.18%	0.70%	-0.01%
过去六个月	1.76%	0.20%	0.10%	0.23%	1.66%	-0.03%
过去一年	2.67%	0.20%	-1.00%	0.24%	3.67%	-0.04%
自基金合同生效起至今	9.71%	0.20%	4.60%	0.24%	5.11%	-0.04%

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

景顺长城顺鑫回报混合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对比图



景顺长城顺鑫回报混合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对比图



注：本基金的投资组合比例为：本基金股票（含存托凭证，下同）投资占基金资产的比例范围为0-50%；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9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		
陈莹	本基金的基金经理	2021年9月10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、《景顺长城顺鑫回报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 8 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

三季度海内外宏观形势仍维持较高波动。海外方面，经济基本面走弱的情况仍没有发生变化，但另一方面，海外持续坚挺的通胀数据使得市场对于美联储后续政策收紧力度的预期不断摇摆与转变，美元指数持续冲高，海外债券收益率、商品价格的波动加大，美元指数冲高也对人民币汇率造成压力，人民币汇率 8 月以来震荡走高，9 月以来连续触及重要关口。国内方面，8 月经济数据表现较好，大多好于市场平均预期，显示三季度经济整体环比修复情况好于市场平均预期。整体上看，经济近期的复苏仍为弱复苏，出口增速受海外经济回落影响有所下降，基建投资增速继续抬升，房地产投资持续下行，制造业投资相对稳定，消费缓慢修复，通胀相对温和。目前经济运行情况体现出政府部门加杠杆托底经济的特征，对经济增长起到一定支撑作用，近期频繁出台的稳增长政策也表现出政府对稳增长的态度与决心。近期各地地产政策在不同程度上略有调整，后续仍需要持续观察其落地情况与政策效果，预计在“房住不炒”背景下，政策出台仍将以稳为主。货币政策方面变化不大，经济复苏动能偏弱的情况下流动性预计仍将保持中性略松状态，但随着稳增长政策发力，信贷边际的好转，后续资金面可能存在边际收敛可能，四季度需观察资金面的边际变化。

三季度债券市场方面，受 8 月超预期降息影响，国内利率债收益率整体震荡下行，相较于 2022 年二季度末，5 年期国债下行 4BP 至 2.58%，10 年期国债下行 6BP 至 2.76%。权益市场方面，呈现出相对弱势格局，今年以来二次探底。上证指数连续 3 个月回调，累计下跌 11%。

三季度组合债券部分采取杠杆套息策略，维持中性的久期和杠杆水平。权益部分以绝对收益为主要思路，结构上以稳健低估值品种为主，辅以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，预计经济基本面仍会温和修复，基建稳增长政策预计将持续落地，地产托底政策也在发力过程中。同时，我们也认识到，国内疫情防控形势总体向好，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。基本面弱复苏下，预期货币政策仍将保持友好，资金面预计仍将维持中性略松状态。

权益市场方面，整体持谨慎乐观看法。目前权益市场估值处于偏低的位置，前期停贷事件发

酵、多地疫情冲击、美元指数偏强导致汇率压力、地缘政治等因素，都明显冲击市场的风险偏好，导致短期市场羸弱，但权益市场的估值水平也对众多利空因素已经有较为充分的定价。中期维度，随着各类政策的逐步落地，宏观经济和企业盈利的回升，权益有望呈震荡向上格局，择机布局具有中长期景气度的板块。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，尤其是中短端品种确定性仍相对较高。在稳增长政策发力过程中，同时叠加相对宽松的资金利率，预计四季度债券收益率以区间震荡为主，在此背景下，票息策略相对占优，组合久期不宜过高，适当利用杠杆策略增厚组合收益。配置方向依然以高等级信用债为主，继续立足票息策略。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2022 年 3 季度，景顺长城顺鑫回报混合 A 类份额净值增长率为-1.27%，业绩比较基准收益率为-2.02%。

2022 年 3 季度，景顺长城顺鑫回报混合 C 类份额净值增长率为-1.32%，业绩比较基准收益率为-2.02%。

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	153,860,851.25	15.90
	其中：股票	153,860,851.25	15.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	793,900,356.43	82.06
	其中：债券	793,900,356.43	82.06
	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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	2,439,386.01	0.25
8	其他资产	17,269,324.85	1.78
9	合计	967,469,918.54	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	207,151.00	0.03
B	采矿业	6,645,816.51	0.80
C	制造业	102,800,185.26	12.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,445,413.00	0.30
E	建筑业	138,110.00	0.02
F	批发和零售业	495,120.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	3,217,151.00	0.39
H	住宿和餐饮业	570,381.76	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,857,254.81	0.22
J	金融业	28,745,691.22	3.47
K	房地产业	2,449,977.00	0.30
L	租赁和商务服务业	1,030,900.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	2,447,196.15	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	21,560.04	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	341,876.50	0.04
R	文化、体育和娱乐业	447,067.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	153,860,851.25	18.57

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	382,880	12,079,864.00	1.46
2	600519	贵州茅台	6,200	11,609,500.00	1.40
3	002311	海大集团	90,900	5,479,452.00	0.66
4	000858	五粮液	26,900	4,552,287.00	0.55
5	000333	美的集团	81,976	4,042,236.56	0.49

6	300750	宁德时代	10,000	4,008,900.00	0.48
7	600036	招商银行	111,300	3,745,245.00	0.45
8	600887	伊利股份	110,100	3,631,098.00	0.44
9	002049	紫光国微	19,320	2,782,080.00	0.34
10	000568	泸州老窖	11,300	2,606,458.00	0.31

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	66,803,372.87	8.06
	其中：政策性金融债	46,717,680.82	5.64
4	企业债券	143,910,044.94	17.37
5	企业短期融资券	2,038,975.89	0.25
6	中期票据	287,818,581.35	34.74
7	可转债（可交换债）	2,951,601.64	0.36
8	同业存单	-	-
9	其他	290,377,779.74	35.05
10	合计	793,900,356.43	95.83

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	1920059	19 江苏银行二级	500,000	51,618,323.29	6.23
2	180204	18 国开 04	450,000	46,717,680.82	5.64
3	2128042	21 兴业银行二级 02	400,000	42,087,846.58	5.08
4	1920046	19 宁波银行二级	300,000	31,287,345.21	3.78
5	2028024	20 中信银行二级	300,000	31,076,143.56	3.75

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

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。

兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码：601166）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。

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 9 月 8 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〕60 号）。其因柜面业务内控管理不到位，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条规定，被处以罚款人民币 25 万元。

2022 年 5 月 27 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〕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。

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。

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。

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	44,613.45
2	应收证券清算款	17,088,944.99
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	135,766.41
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	17,269,324.85

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	110059	浦发转债	1,286,312.75	0.16
2	113057	中银转债	498,207.95	0.06
3	110053	苏银转债	34,139.68	0.00

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	景顺长城顺鑫回报混合 A 类	景顺长城顺鑫回报混合 C 类
报告期期初基金份额总额	434,215,667.94	358,286,279.26
报告期期间基金总申购份额	4,578,440.94	64,707,504.28
减:报告期期间基金总赎回份额	27,028,356.09	81,109,226.71
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	411,765,752.79	341,884,556.83

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顺鑫回报混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城顺鑫回报混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《景顺长城顺鑫回报混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城顺鑫回报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 10 月 26 日