

# 景顺长城安瑞混合型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 9 月 23 日（基金合同生效日）起至 2022 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>         | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 10        |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况                       | 10        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 14        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 16        |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 16        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 16        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 16        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 17        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>17</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 17        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 17        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>19</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 19        |
| 7.2 利润表                                 | 20        |
| 7.3 净资产（基金净值）变动表                        | 21        |
| 7.4 报表附注                                | 22        |

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§ 8 投资组合报告</b> .....                            | <b>46</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                               | 46        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                         | 46        |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....            | 47        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                          | 48        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                         | 50        |
| 8.6 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 .....           | 50        |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....        | 50        |
| 8.8 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贵金属投资明细 .....        | 50        |
| 8.9 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 .....           | 50        |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                          | 50        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....                    | 51        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                                | 51        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....                         | <b>54</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                        | 54        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                     | 54        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....             | 54        |
| 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 ..... | 54        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....                        | <b>55</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示</b> .....                           | <b>55</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                             | 55        |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....             | 55        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....                  | 55        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                               | 55        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                        | 55        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....                | 56        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                       | 56        |
| 11.8 其他重大事件 .....                                  | 57        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....                   | <b>59</b> |
| 12.1 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 .....           | 59        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                          | 59        |
| <b>§ 13 备查文件目录</b> .....                           | <b>59</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                                  | 59        |
| 13.2 存放地点 .....                                    | 60        |
| 13.3 查阅方式 .....                                    | 60        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金名称            | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金  |                 |
| 基金简称            | 景顺长城安瑞混合         |                 |
| 基金主代码           | 012137           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2022 年 9 月 23 日  |                 |
| 基金管理人           | 景顺长城基金管理有限公司     |                 |
| 基金托管人           | 兴业银行股份有限公司       |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 351,693,981.59 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 景顺长城安瑞混合 A       | 景顺长城安瑞混合 C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 012137           | 014926          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 263,793,371.60 份 | 87,900,609.99 份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 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>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、信用债投资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。</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<br/>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<br/>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。</p> <p>7、股票期权投资策略<br/>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、信用衍生品投资策略<br/>本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。</p> <p>9、融资策略<br/>本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。</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*15%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%  |
| 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>   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                        | 基金托管人                      |
|-------------|------|------------------------------|----------------------------|
| 名称          |      | 景顺长城基金管理有限公司                 | 兴业银行股份有限公司                 |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 杨崑阳                          | 龚小武                        |
|             | 联系电话 | 0755-82370388                | 021-52629999-212056        |
|             | 电子邮箱 | investor@igwfm.com           | gongxiaowu@cib.com.cn      |
| 客户服务电话      |      | 4008888606                   | 95561                      |
| 传真          |      | 0755-22381339                | 021-62159217               |
| 注册地址        |      | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |
| 办公地址        |      | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼       |
| 邮政编码        |      | 518048                       | 200120                     |
| 法定代表人       |      | 李进                           | 吕家进                        |

### 2.4 信息披露方式

|                     |               |
|---------------------|---------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报          |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.igwfm.com |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人的办公场所    |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                       | 办公地址                         |
|--------|--------------------------|------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所<br>(特殊普通合伙) | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼  |
| 注册登记机构 | 景顺长城基金管理有限公司             | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2022 年 9 月 23 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|---|---------------|
|               | 景顺长城安瑞混合 A                                | 景顺长城安瑞混合 C    |
| 本期已实现收益       | 1,674,829.24                              | 486,068.59    |
| 本期利润          | 594,530.17                                | 103,145.41    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0022                                    | 0.0011        |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.22%                                     | 0.11%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.22%                                     | 0.11%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2022 年末                                   |               |
| 期末可供分配利润      | 591,832.61                                | 101,846.97    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0022                                    | 0.0012        |
| 期末基金资产净值      | 264,385,204.21                            | 88,002,456.96 |
| 期末基金份额净值      | 1.0022                                    | 1.0011        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2022 年末                                   |               |
| 基金份额累计净值增长率   | 0.22%                                     | 0.11%         |

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

4、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。

5、本基金基金合同生效日为 2022 年 9 月 23 日。

### 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

景顺长城安瑞混合 A

| 阶段 | 份额净值 | 份额净值增 | 业绩比较 | 业绩比较基 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|-------|------|-------|-----|-----|
|----|------|-------|------|-------|-----|-----|

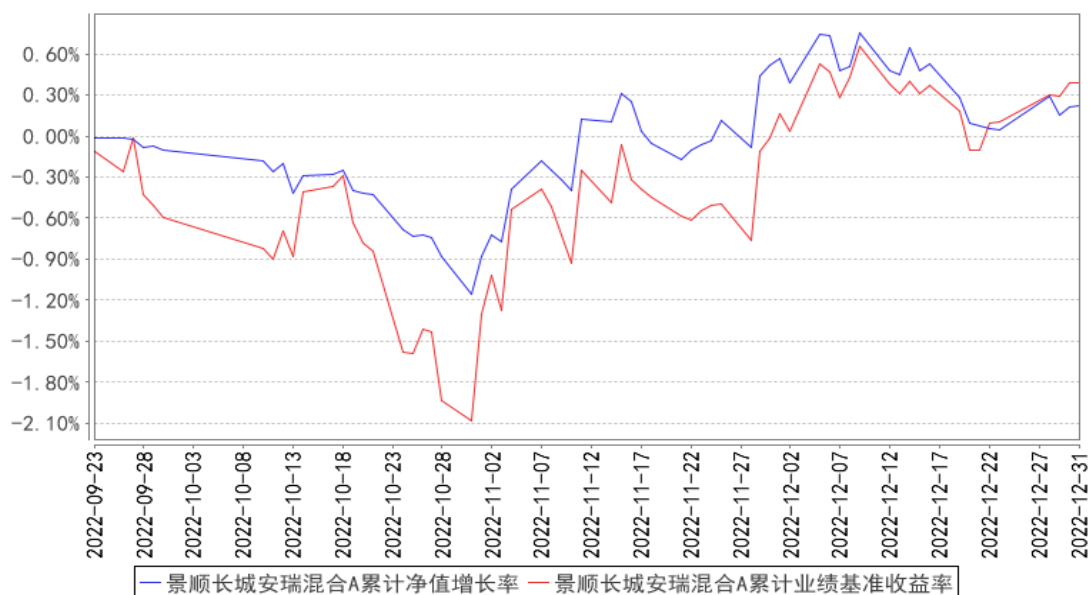
|            | 增长率①  | 长率标准差② | 基准收益率③ | 准收益率标准差④ |        |        |
|------------|-------|--------|--------|----------|--------|--------|
| 过去三个月      | 0.32% | 0.18%  | 0.99%  | 0.29%    | -0.67% | -0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.22% | 0.17%  | 0.39%  | 0.28%    | -0.17% | -0.11% |

景顺长城安瑞混合 C

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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      | 0.22%    | 0.18%       | 0.99%      | 0.29%         | -0.77% | -0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.11%    | 0.17%       | 0.39%      | 0.28%         | -0.28% | -0.11% |

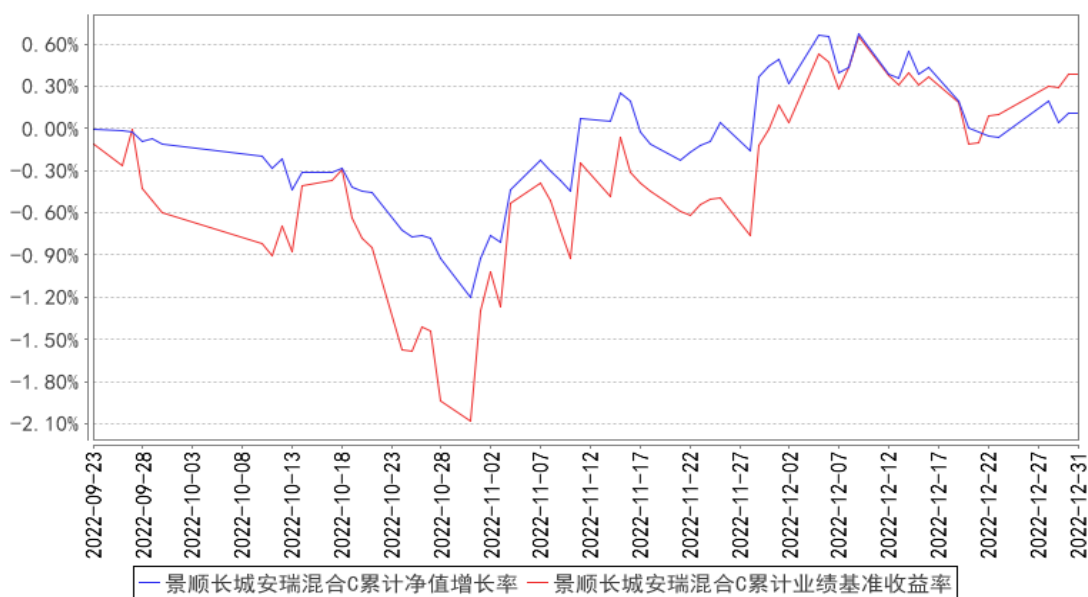
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

景顺长城安瑞混合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





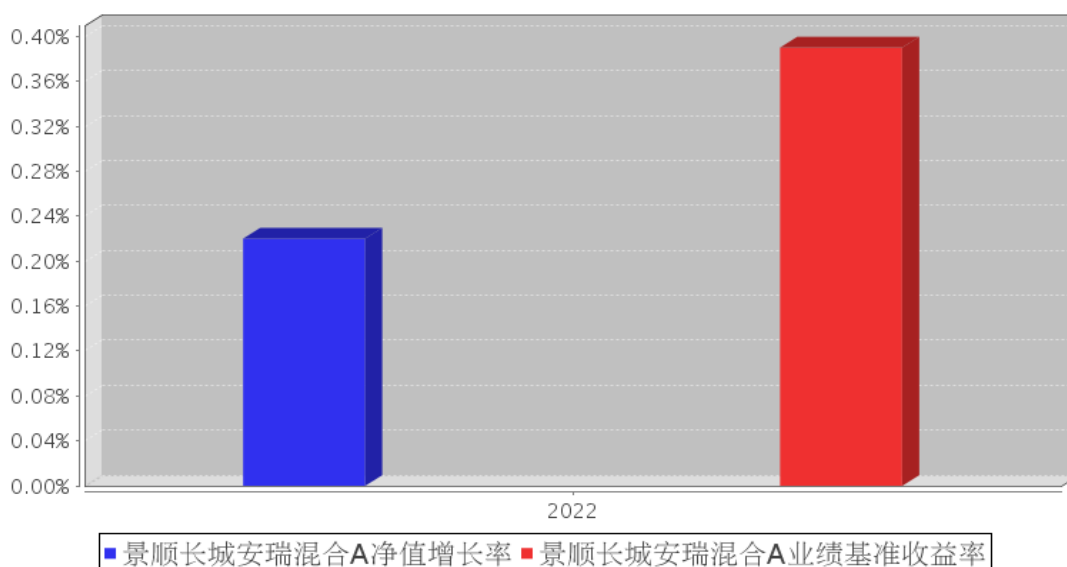
景顺长城安瑞混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



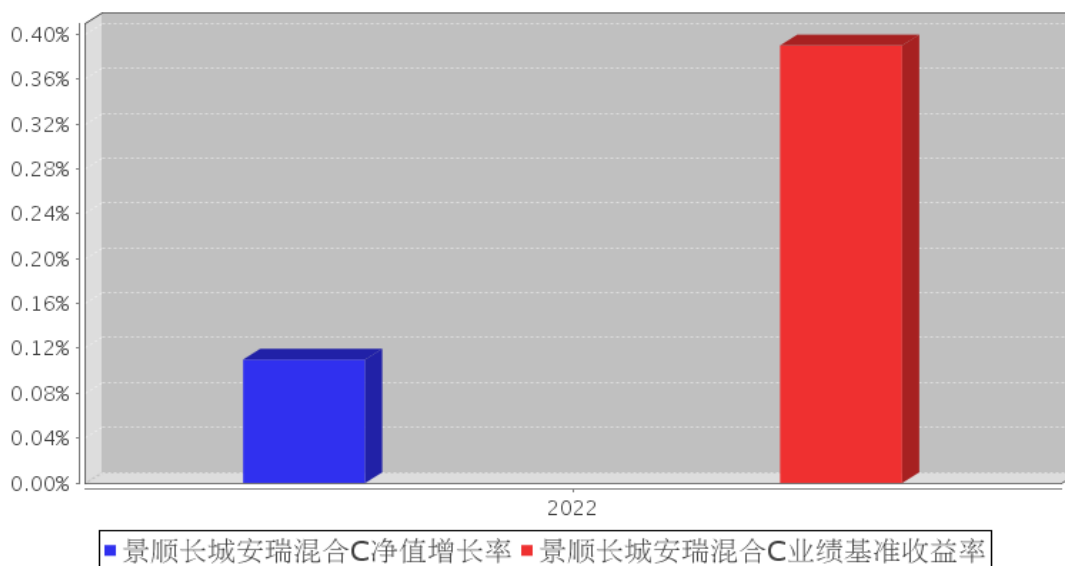
注：基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-40%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；投资于同业存单比例不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2022 年 9 月 23 日基金合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2022 年 9 月 23 日）起至本报告期末不满一年。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城安瑞混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



景顺长城安瑞混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2022 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2022 年 9 月 23 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2022年9月23日（基金合同生效日）至本期期末未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003] 76 号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2022 年 12 月 31 日，本公司旗下共管理 165 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|----------|-----------------|------|--------|--|
|     |          | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 李怡文 | 本基金的基金经理 | 2022 年 9 月 23 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。 |

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。

#### 4.1.3 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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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、《景顺长城安瑞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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》、《基金经理兼任

私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

#### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

#### 2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

#### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

#### 4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

### 4.3.2 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投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易的情况。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.3.3 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 47 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2022 年，国内外市场均经历了较大波动。海外方面，年初俄乌冲突爆发与劳动力供给短缺加剧，推动美国能源与服务价格超预期上行，美联储在中期选举前大幅加息遏制通胀并带动美元走强，全球资本市场整体承压。中美利差则自 2010 年以来首次倒挂，资本外流压力加大制约国内风险资产表现。国内方面，疫情对经济供需两端多次产生冲击。在经济存在不确定性、疫情制约消费场景的情况下，实体经济特别是居民部门信心较差，储蓄意愿强烈、消费恢复缓慢、地产销售持续低迷。尽管央行通过两次降准、两次 MLF 降息、上缴万亿利润的方式“宽货币”，推动 M2 增速达到 2017 年以来新高，财政则通过大规模“留抵退税”、加量专项债额度、推出政策性金融工具等方式支持企业部门、加快基建投资，但“宽信用”不及市场预期，全年社融增速低于 2021 年 0.7 个百分点。而 2022 年 10 月份以后，随着美国中期选举结束、经济数据在高利率压制下疲态初显，美债利率下行、美元走弱，外部压力降低，而国内疫情防控政策也出现变化，在预期消费复苏、经济逐步向好的背景下，股票市场迎来转机，大幅反弹。全年来看，国内股票市场全年呈现出倒 N 型走势，上证指数全年收跌 15.13%。债市则走势震荡，收益率先下后上，结构分化，中短端下行长端上行，1Y/3Y/5Y/10Y 国债分别变动-14.6bp/-5.44bp/3.54bp/5.99bp。

本基金自 2022 年 9 月 23 日成立。由于我们对股票市场相对乐观，采取了相对偏积极的建仓策略，结构上以上游资源以及和中国经济景气度相关较高的大消费、大金融行业为主，少量配置

一些成长板块。对于债券市场，我们一直保持相对谨慎态度，因此我们债券建仓节奏一直较为缓慢。我们抓住 11 月份因为理财净值大幅波动，债市大幅调整的时机积极建仓一些高等级、中低久期的信用债以及短久期利率债，较好回避了债市调整风险。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2022 年 9 月 23 日（基金合同生效日）至本报告期末，景顺长城安瑞混合 A 类份额净值增长率为 0.22%，业绩比较基准收益率为 0.39%；

2022 年 9 月 23 日（基金合同生效日）至本报告期末，景顺长城安瑞混合 C 类份额净值增长率为 0.11%，业绩比较基准收益率为 0.39%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，我们预计国内将开启新一轮的经济周期。国内经济当前已在磨底期。具体看来，地产托底政策初见成效，各地方的地产需求端政策也在发力；制造业当前盈利尚未企稳，叠加出口下行，或阶段性承压；在线下消费场景逐步恢复、居民需求积压和存在相当比例超额储蓄的背景下，消费明年或对经济形成明显支撑。此外，大宗商品价格显著回落，美联储加息接近尾声，今年上半年或将结束本轮加息周期，海外因素对国内市场的影响弱化。总体上看，我们对今年国内经济的情况保持乐观。因此，从中期看，经济见底回升会带动利率中枢上移，维持对债券的谨慎观点。股票方面，当前 A 股估值已处于历史相对低位，结构性低估情况较为明显，仍维持对股票市场相对乐观的态度，后续重点关注经济恢复情况，一方面继续关注由于产能周期影响周期性弱化的上游周期行业的配置机会，另一方面则重点关注受益于国内宏观经济景气程度回升的个股和行业以及竞争优势明显、景气程度可持续的高端制造业及受益于潜在政策支持的安全/自主可控领域等。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI(Key Performance Indicator 主要绩效指标)为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核

与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及其适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截至本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的



规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2023)第 24172 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|                 |  |
|-----------------|--|
| 审计报告标题          | 审计报告   |
| 审计报告收件人         | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金全体基金份额持有人   |
| 审计意见            | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城安瑞混合型证券投资基金(以下简称“景顺长城安瑞混合基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了景顺长城安瑞混合基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于景顺长城安瑞混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>   |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>景顺长城安瑞混合基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估景顺长</p>  |

|                 |  |
|-----------------|--|
|                 | <p>城安瑞混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算景顺长城安瑞混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督景顺长城安瑞混合基金的财务报告过程。</p>   |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对景顺长城安瑞混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城安瑞混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称       | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)   |
| 注册会计师的姓名        | 单峰 郭劲扬   |
| 会计师事务所的地址       | 中国上海市  |
| 审计报告日期          | 2023 年 3 月 24 日  |

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城安瑞混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|---------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                 |
| 银行存款          | 7.4.7.1    | 1,870,715.84                    |
| 结算备付金         |            | 226,493.56                      |
| 存出保证金         |            | 19,571.85                       |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2    | 338,210,550.38                  |
| 其中：股票投资       |            | 51,627,555.84                   |
| 基金投资          |            | -                               |
| 债券投资          |            | 286,582,994.54                  |
| 资产支持证券投资      |            | -                               |
| 贵金属投资         |            | -                               |
| 其他投资          |            | -                               |
| 衍生金融资产        | 7.4.7.3    | -                               |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | 19,219,088.88                   |
| 债权投资          | 7.4.7.5    | -                               |
| 其中：债券投资       |            | -                               |
| 资产支持证券投资      |            | -                               |
| 其他投资          |            | -                               |
| 其他债权投资        | 7.4.7.6    | -                               |
| 其他权益工具投资      | 7.4.7.7    | -                               |
| 应收清算款         |            | -                               |
| 应收股利          |            | -                               |
| 应收申购款         |            | -                               |
| 递延所得税资产       |            | -                               |
| 其他资产          | 7.4.7.8    | -                               |
| 资产总计          |            | 359,546,420.51                  |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                                 |
| 短期借款          |            | -                               |
| 交易性金融负债       |            | -                               |
| 衍生金融负债        | 7.4.7.3    | -                               |
| 卖出回购金融资产款     |            | 3,001,178.64                    |
| 应付清算款         |            | 3.12                            |
| 应付赎回款         |            | 3,637,693.90                    |

|             |          |                |
|-------------|----------|----------------|
| 应付管理人报酬     |          | 245,457.22     |
| 应付托管费       |          | 61,364.31      |
| 应付销售服务费     |          | 31,771.75      |
| 应付投资顾问费     |          | -              |
| 应交税费        |          | 6,847.03       |
| 应付利润        |          | -              |
| 递延所得税负债     |          | -              |
| 其他负债        | 7.4.7.9  | 174,443.37     |
| 负债合计        |          | 7,158,759.34   |
| <b>净资产：</b> |          |                |
| 实收基金        | 7.4.7.10 | 351,693,981.59 |
| 其他综合收益      | 7.4.7.11 | -              |
| 未分配利润       | 7.4.7.12 | 693,679.58     |
| 净资产合计       |          | 352,387,661.17 |
| 负债和净资产总计    |          | 359,546,420.51 |

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 351,693,981.59 份，其中景顺长城安瑞混合 A 类基金份额净值 1.0022 元，基金份额 263,793,371.60 份；景顺长城安瑞混合 C 类基金份额净值 1.0011 元，基金份额 87,900,609.99 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2022 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：景顺长城安瑞混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 9 月 23 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目               | 附注号      | 本期   |
|-------------------|----------|--|
|                   |          | 2022 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日 |
| <b>一、营业总收入</b>    |          | 1,890,229.68                               |
| 1. 利息收入           |          | 628,229.92                                 |
| 其中：存款利息收入         | 7.4.7.13 | 113,932.49                                 |
| 债券利息收入            |          | -  |
| 资产支持证券利息收入        |          | -  |
| 买入返售金融资产收入        |          | 514,297.43                                 |
| 证券出借利息收入          |          | -  |
| 其他利息收入            |          | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 2,716,733.67                               |
| 其中：股票投资收益         | 7.4.7.14 | 1,274,714.69                               |
| 基金投资收益            |          | -  |
| 债券投资收益            | 7.4.7.15 | 1,406,420.93                               |
| 资产支持证券投资收益        | 7.4.7.16 | -  |

|                            |            |                     |
|----------------------------|------------|---------------------|
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.17   | -                   |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.18   | -                   |
| 股利收益                       | 7.4.7.19   | 35,598.05           |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益      |            | -                   |
| 其他投资收益                     |            | -                   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.20   | -1,463,222.25       |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -                   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 7.4.7.21   | 8,488.34            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | <b>1,192,554.10</b> |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 782,590.10          |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 195,647.48          |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 101,672.88          |
| 4. 投资顾问费                   |            | -                   |
| 5. 利息支出                    |            | 7,049.91            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 7,049.91            |
| 6. 信用减值损失                  | 7.4.7.22   | -                   |
| 7. 税金及附加                   |            | 2,552.40            |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.23   | 103,041.33          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>697,675.58</b>   |
| 减：所得税费用                    |            | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>697,675.58</b>   |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | <b>-</b>            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | <b>697,675.58</b>   |

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城安瑞混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 9 月 23 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022 年 9 月 23 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 |        |       |                |
|-----------------|--|--------|-------|----------------|
|                 | 实收基金   | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | -  | -      | -     | -              |
| 加：会计政策变更        | -  | -      | -     | -              |
| 前期差错更正          | -  | -      | -     | -              |
| 其他              | -  | -      | -     | -              |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 361,230,858.44                                   | -      | -     | 361,230,858.44 |

|  |                |   |            |                |
|--|----------------|---|------------|----------------|
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                 | -9,536,876.85  | - | 693,679.58 | -8,843,197.27  |
| (一)、综合收益总额                               | -              | - | 697,675.58 | 697,675.58     |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | -9,536,876.85  | - | -3,996.00  | -9,540,872.85  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 219.62         | - | 0.37       | 219.99         |
| 2. 基金赎回款                                 | -9,537,096.47  | - | -3,996.37  | -9,541,092.84  |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -              | - | -          | -              |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -              | - | -          | -              |
| 四、本期期末净资产<br>(基金净值)                      | 351,693,981.59 | - | 693,679.58 | 352,387,661.17 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

景顺长城安瑞混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]4111号《关于准予景顺长城安瑞混合型证券投资基金注册的批复》注册,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币361,098,924.31元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第0803号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金合同》于2022年9月23日正式生效,基金合同生效

日的基金份额总额为 361,230,858.44 份基金份额，其中认购资金利息折合 131,934.13 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金合同》和《景顺长城安瑞混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取前端认购费/申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购费/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债券、公开发行的次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债的纯债部分、可交换债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款等)、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、股票期权、股指期货、国债期货、信用衍生品以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据法律法规的规定参与融资业务。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为 0-40%，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以后，应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。本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2023 年 3 月 24 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及

允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日 止期间度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具, 是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时, 确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为: 以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具, 分别采用以下两种方式进行计量:

##### 以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标, 且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致, 即在特定日期产生的现金流量, 仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益:

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具, 以公允价值计量且其变动计入当期损



益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失

准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额

持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性

折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴

纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前(如适用)运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以 2018 年 1 月 1 日起(如适用)产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利,H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请,由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册,H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利,由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

| 项目      | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------|-------------------------|
| 活期存款    | 1,870,715.84            |
| 等于: 本金  | 1,869,927.82            |
| 加: 应计利息 | 788.02                  |

|                   |              |
|-------------------|--------------|
| 减：坏账准备            | -            |
| 定期存款              | -            |
| 等于：本金             | -            |
| 加：应计利息            | -            |
| 减：坏账准备            | -            |
| 其中：存款期限 1 个月以内    | -            |
| 存款期限 1 个月（含）-3 个月 | -            |
| 其他存款              | -            |
| 等于：本金             | -            |
| 加：应计利息            | -            |
| 减：坏账准备            | -            |
| 合计                | 1,870,715.84 |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 |                |                |                |             |
|---------------|-------------------------|----------------|----------------|----------------|-------------|
|               | 成本                      | 应计利息           | 公允价值           | 公允价值变动         |             |
| 股票            | 52,613,097.71           | -              | 51,627,555.84  | -985,541.87    |             |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                       | -              | -              | -              |             |
| 债券            | 交易所市场                   | 90,063,211.90  | 1,240,985.99   | 91,048,798.39  | -255,399.50 |
|               | 银行间市场                   | 193,214,280.88 | 2,542,196.15   | 195,534,196.15 | -222,280.88 |
|               | 合计                      | 283,277,492.78 | 3,783,182.14   | 286,582,994.54 | -477,680.38 |
| 资产支持证券        | -                       | -              | -              | -              |             |
| 基金            | -                       | -              | -              | -              |             |
| 其他            | -                       | -              | -              | -              |             |
| 合计            | 335,890,590.49          | 3,783,182.14   | 338,210,550.38 | -1,463,222.25  |             |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 |           |
|-------|-------------------------|-----------|
|       | 账面余额                    | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                       | -         |
| 银行间市场 | 19,219,088.88           | -         |
| 合计    | 19,219,088.88           | -         |

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

#### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

#### 7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       |
| 应付赎回费       | 1,772.97                |



|           |            |
|-----------|------------|
| 应付证券出借违约金 | -          |
| 应付交易费用    | 76,670.40  |
| 其中：交易所市场  | 62,113.96  |
| 银行间市场     | 14,556.44  |
| 应付利息      | -          |
| 预提费用      | 96,000.00  |
| 合计        | 174,443.37 |

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 景顺长城安瑞混合 A

| 项目            | 本期<br>2022年9月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 基金合同生效日       | 267,185,948.11                        | 267,185,948.11 |
| 本期申购          | 9.99                                  | 9.99           |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,392,586.50                         | -3,392,586.50  |
| 本期末           | 263,793,371.60                        | 263,793,371.60 |

##### 景顺长城安瑞混合 C

| 项目            | 本期<br>2022年9月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |               |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额          |
| 基金合同生效日       | 94,044,910.33                         | 94,044,910.33 |
| 本期申购          | 209.63                                | 209.63        |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -6,144,509.97                         | -6,144,509.97 |
| 本期末           | 87,900,609.99                         | 87,900,609.99 |

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金合同于2022年9月23日生效。首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币361,098,924.31元，折合361,098,924.31份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币131,934.13元，折合131,934.13份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币361,230,858.44元，折合361,230,858.44份基金份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 景顺长城安瑞混合 A

| 项目         | 已实现部分        | 未实现部分         | 未分配利润合计    |
|------------|--------------|---------------|------------|
| 基金合同生效日    | -            | -             | -          |
| 本期利润       | 1,674,829.24 | -1,080,299.07 | 594,530.17 |
| 本期基金份额交易产生 | -19,883.45   | 17,185.89     | -2,697.56  |

|          |              |               |            |
|----------|--------------|---------------|------------|
| 的变动数     |              |               |            |
| 其中：基金申购款 | 0.05         | -0.05         | -          |
| 基金赎回款    | -19,883.50   | 17,185.94     | -2,697.56  |
| 本期已分配利润  | -            | -             | -          |
| 本期末      | 1,654,945.79 | -1,063,113.18 | 591,832.61 |

## 景顺长城安瑞混合 C

| 项目             | 已实现部分      | 未实现部分       | 未分配利润合计    |
|----------------|------------|-------------|------------|
| 基金合同生效日        | -          | -           | -          |
| 本期利润           | 486,068.59 | -382,923.18 | 103,145.41 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -30,185.30 | 28,886.86   | -1,298.44  |
| 其中：基金申购款       | 1.05       | -0.68       | 0.37       |
| 基金赎回款          | -30,186.35 | 28,887.54   | -1,298.81  |
| 本期已分配利润        | -          | -           | -          |
| 本期末            | 455,883.29 | -354,036.32 | 101,846.97 |

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2022年9月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 活期存款利息收入  | 28,200.90                       |
| 定期存款利息收入  | 80,694.44                       |
| 其他存款利息收入  | -                               |
| 结算备付金利息收入 | 4,927.14                        |
| 其他        | 110.01                          |
| 合计        | 113,932.49                      |

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期                              |
|------------------|---------------------------------|
|                  | 2022年9月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 1,274,714.69                    |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                               |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                               |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                               |
| 合计               | 1,274,714.69                    |

## 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期                              |
|----------|---------------------------------|
|          | 2022年9月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 卖出股票成交总额 | 22,918,764.56                   |

|            |               |
|------------|---------------|
| 减：卖出股票成本总额 | 21,493,639.89 |
| 减：交易费用     | 150,409.98    |
| 买卖股票差价收入   | 1,274,714.69  |

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                              |
|------------------------------|---------------------------------|
|                              | 2022年9月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 2,310,079.33                    |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -903,658.40                     |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                               |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                               |
| 合计                           | 1,406,420.93                    |

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                              |
|------------------------|---------------------------------|
|                        | 2022年9月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 214,965,700.42                  |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 211,919,076.29                  |
| 减：应计利息总额               | 3,944,471.22                    |
| 减：交易费用                 | 5,811.31                        |
| 买卖债券差价收入               | -903,658.40                     |

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                              |
|---------------|---------------------------------|
|               | 2022年9月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 35,598.05                       |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                               |
| 基金投资产生的股利收益   | -                               |
| 合计            | 35,598.05                       |

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期                              |
|----------------------------|---------------------------------|
|                            | 2022年9月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 1. 交易性金融资产                 | -1,463,222.25                   |
| 股票投资                       | -985,541.87                     |
| 债券投资                       | -477,680.38                     |
| 资产支持证券投资                   | -                               |
| 基金投资                       | -                               |
| 贵金属投资                      | -                               |
| 其他                         | -                               |
| 2. 衍生工具                    | -                               |
| 权证投资                       | -                               |
| 3. 其他                      | -                               |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的<br>预估增值税 | -                               |
| 合计                         | -1,463,222.25                   |

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2022年9月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | 8,488.34                        |
| 合计      | 8,488.34                        |

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2022年9月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 审计费用      | 50,000.00                       |
| 信息披露费     | 40,000.00                       |
| 证券出借违约金   | -                               |
| 债券托管账户维护费 | 6,000.00                        |
| 银行划款手续费   | 6,441.85                        |
| 其他        | 400.00                          |
| 证券组合费     | 199.48                          |
| 合计        | 103,041.33                      |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称              | 与本基金的关系           |
|--------------------|-------------------|
| 景顺长城基金管理有限公司       | 基金管理人、登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”） | 基金托管人、基金销售机构      |
| 长城证券股份有限公司（“长城证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构   |
| 大连实德集团有限公司         | 基金管理人的股东          |
| 景顺资产管理有限公司         | 基金管理人的股东          |
| 开滦(集团)有限责任公司       | 基金管理人的股东          |
| 景顺长城资产管理(深圳)有限公司   | 基金管理人的子公司         |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                              |
|-----------------|---------------------------------|
|                 | 2022年9月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 782,590.10                      |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 378,186.39                      |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X0.80%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              |
|----------------|---------------------------------|
|                | 2022年9月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 195,647.48                      |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X0.20%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                              |            |           |
|----------------|---------------------------------|------------|-----------|
|                | 2022年9月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |            |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |           |
|                | 景顺长城安瑞混合 A                      | 景顺长城安瑞混合 C | 合计        |
| 景顺长城基金管理有限公司   | -                               | 0.99       | 0.99      |
| 兴业银行           | -                               | 47,539.32  | 47,539.32 |
| 长城证券           | -                               | 5,284.20   | 5,284.20  |
| 合计             | -                               | 52,824.51  | 52,824.51 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X0.40%/当年天数。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期末未发生转融通证券出借业务交易。

**7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期末未发生转融通证券出借业务交易。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人于本报告期末未运用自有资金投资本基金。

**7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本基金的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方名称   | 本期<br>2022年9月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |           |
|---------|---------------------------------------|-----------|
|         | 期末余额                                  | 当期利息收入    |
| 兴业银行-活期 | 1,870,715.84                          | 28,200.90 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内无利润分配。

**7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,001,178.64 元，截至 2023 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。



本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 66.76%。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日

可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022年12月<br>31日 | 1个月以内         | 1-3个月         | 3个月-1年        | 1-5年          | 5年以上           | 不计息           | 合计             |
|------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|---------------|----------------|
| 资产                     |               |               |               |               |                |               |                |
| 银行存款                   | 1,870,715.84  | -             | -             | -             | -              | -             | 1,870,715.84   |
| 结算备付金                  | 226,493.56    | -             | -             | -             | -              | -             | 226,493.56     |
| 存出保证金                  | 19,571.85     | -             | -             | -             | -              | -             | 19,571.85      |
| 交易性金融资产                | 4,386,901.23  | 53,306,526.79 | 15,380,683.50 | 48,738,906.05 | 164,769,976.97 | 51,627,555.84 | 338,210,550.38 |
| 买入返售金融资产               | 19,219,088.88 | -             | -             | -             | -              | -             | 19,219,088.88  |
| 资产总计                   | 25,722,771.36 | 53,306,526.79 | 15,380,683.50 | 48,738,906.05 | 164,769,976.97 | 51,627,555.84 | 359,546,420.51 |
| 负债                     |               |               |               |               |                |               |                |
| 应付赎回款                  | -             | -             | -             | -             | -              | 3,637,693.90  | 3,637,693.90   |

|           |               |               |               |               |                |              |              |
|-----------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|--------------|--------------|
| 应付管理人报酬   | -             | -             | -             | -             | -              | 245,457.22   | 245,457.22   |
| 应付托管费     | -             | -             | -             | -             | -              | 61,364.31    | 61,364.31    |
| 应付证券清算款   | -             | -             | -             | -             | -              | 3.12         | 3.12         |
| 卖出回购金融资产款 | 3,001,178.64  | -             | -             | -             | -              | -            | 3,001,178.64 |
| 应付销售服务费   | -             | -             | -             | -             | -              | 31,771.75    | 31,771.75    |
| 应交税费      | -             | -             | -             | -             | -              | 6,847.03     | 6,847.03     |
| 其他负债      | -             | -             | -             | -             | -              | 174,443.37   | 174,443.37   |
| 负债总计      | 3,001,178.64  | -             | -             | -             | -              | 4,157,580.70 | 7,158,759.34 |
| 利率敏感度缺口   | 22,721,592.72 | 53,306,526.79 | 15,380,683.50 | 48,738,906.05 | 164,769,976.97 | -            | -            |

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                    |                             |
|----|--------------------|-----------------------------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |
|    | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
|    |                    | 本期末（2022年12月31日）            |
| 分析 | 市场利率上升 25 个基点      | -575,293.29                 |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 578,449.68                  |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2022年12月31日 |               |                |               |
|----------|--------------------|---------------|----------------|---------------|
|          | 美元<br>折合人民币元       | 港币<br>折合人民币元  | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计            |
| 以外币计价的资产 |                    |               |                |               |
| 交易性金融资产  | -                  | 14,155,810.49 | -              | 14,155,810.49 |
| 资产合计     | -                  | 14,155,810.49 | -              | 14,155,810.49 |
| 以外币计价的负债 |                    |               |                |               |
| 负债合计     | -                  | -             | -              | -             |

|               |   |               |   |               |
|---------------|---|---------------|---|---------------|
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 14,155,810.49 | - | 14,155,810.49 |
|---------------|---|---------------|---|---------------|

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率外的其他市场变量保持不变 |                             |
|----|-----------------|-----------------------------|
|    | 相关风险变量的变动       | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
|    |                 | 本期末（2022年12月31日）            |
| 分析 | 所有外币相对人民币升值 5%  | 707,790.52                  |
|    | 所有外币相对人民币贬值 5%  | -707,790.52                 |

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022年12月31日 |              |
|---------------|--------------------|--------------|
|               | 公允价值               | 占基金资产净值比例(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 51,627,555.84      | 14.65        |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                  | -            |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                  | -            |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                  | -            |
| 其他            | -                  | -            |
| 合计            | 51,627,555.84      | 14.65        |

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变 |                             |
|----|-------------------------|-----------------------------|
|    | 相关风险变量的变动               | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
|    |                         | 本期末（2022年12月31日）            |
| 分析 | 沪深 300 指数上升 5%          | 2,649,899.58                |
|    | 沪深 300 指数下降 5%          | -2,649,899.58               |

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|
| 第一层次          | 81,438,159.74           |
| 第二层次          | 256,772,390.64          |
| 第三层次          | -                       |
| 合计            | 338,210,550.38          |

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公

允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 51,627,555.84  | 14.36         |
|    | 其中：股票             | 51,627,555.84  | 14.36         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 286,582,994.54 | 79.71         |
|    | 其中：债券             | 286,582,994.54 | 79.71         |
|    | 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          | 19,219,088.88  | 5.35          |
|    | 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      | 2,097,209.40   | 0.58          |
| 8  | 其他各项资产            | 19,571.85      | 0.01          |
| 9  | 合计                | 359,546,420.51 | 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 14,155,810.49 元，占基金资产净值的比例为 4.02%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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              | 15,849,153.00 | 4.50          |
| C  | 制造业              | 15,358,758.24 | 4.36          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -             |
| E  | 建筑业              | 352,202.00    | 0.10          |
| F  | 批发和零售业           | -             | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 726,100.00    | 0.21          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务   | 364,202.73    | 0.10          |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
|   | 业             |               |       |
| J | 金融业           | 4,821,329.38  | 1.37  |
| K | 房地产业          | -             | -     |
| L | 租赁和商务服务业      | -             | -     |
| 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            | 37,471,745.35 | 10.63 |

### 8.2.2 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     | 1,262,699.67  | 0.36         |
| 周期性消费品  | 1,303,727.57  | 0.37         |
| 非周期性消费品 | -             | -            |
| 综合      | -             | -            |
| 能源      | 7,637,181.59  | 2.17         |
| 金融      | 2,298,026.41  | 0.65         |
| 基金      | -             | -            |
| 工业      | -             | -            |
| 信息技术    | -             | -            |
| 公用事业    | -             | -            |
| 通讯      | 1,654,175.25  | 0.47         |
| 合计      | 14,155,810.49 | 4.02         |

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 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  | 00883  | 中国海洋石油 | 543,000 | 4,840,755.19 | 1.37         |
| 2  | 601225 | 陕西煤业   | 214,800 | 3,990,984.00 | 1.13         |
| 3  | 601857 | 中国石油   | 598,200 | 2,973,054.00 | 0.84         |
| 4  | 01898  | 中煤能源   | 493,000 | 2,796,426.40 | 0.79         |
| 5  | 000858 | 五粮液    | 13,000  | 2,348,970.00 | 0.67         |
| 6  | 000001 | 平安银行   | 175,100 | 2,304,316.00 | 0.65         |
| 7  | 000333 | 美的集团   | 40,800  | 2,113,440.00 | 0.60         |
| 8  | 00753  | 中国国航   | 210,000 | 1,303,727.57 | 0.37         |
| 8  | 601111 | 中国国航   | 68,500  | 726,100.00   | 0.21         |
| 9  | 03690  | 美团-W   | 10,600  | 1,654,175.25 | 0.47         |
| 10 | 601001 | 晋控煤业   | 136,800 | 1,636,128.00 | 0.46         |

|    |        |        |         |              |      |
|----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 11 | 000983 | 山西焦煤   | 133,000 | 1,549,450.00 | 0.44 |
| 12 | 601318 | 中国平安   | 31,200  | 1,466,400.00 | 0.42 |
| 13 | 000932 | 华菱钢铁   | 299,700 | 1,408,590.00 | 0.40 |
| 14 | 600460 | 士兰微    | 42,000  | 1,377,180.00 | 0.39 |
| 15 | 600348 | 华阳股份   | 86,000  | 1,225,500.00 | 0.35 |
| 16 | 600519 | 贵州茅台   | 700     | 1,208,900.00 | 0.34 |
| 17 | 06886  | HTSC   | 150,000 | 1,196,535.17 | 0.34 |
| 18 | 601666 | 平煤股份   | 108,300 | 1,170,723.00 | 0.33 |
| 19 | 601899 | 紫金矿业   | 110,600 | 1,106,000.00 | 0.31 |
| 20 | 00688  | 中国海外发展 | 57,500  | 1,058,078.32 | 0.30 |
| 21 | 002409 | 雅克科技   | 20,923  | 1,053,891.51 | 0.30 |
| 22 | 300447 | 全信股份   | 63,000  | 970,200.00   | 0.28 |
| 23 | 300059 | 东方财富   | 49,900  | 968,060.00   | 0.27 |
| 24 | 300699 | 光威复材   | 13,000  | 939,250.00   | 0.27 |
| 25 | 600497 | 驰宏锌锗   | 169,700 | 858,682.00   | 0.24 |
| 26 | 01208  | 五矿资源   | 440,000 | 786,077.60   | 0.22 |
| 27 | 000733 | 振华科技   | 6,500   | 742,495.00   | 0.21 |
| 28 | 002128 | 电投能源   | 54,900  | 677,466.00   | 0.19 |
| 29 | 600256 | 广汇能源   | 73,300  | 661,166.00   | 0.19 |
| 30 | 02099  | 中国黄金国际 | 23,300  | 476,622.07   | 0.14 |
| 31 | 688012 | 中微公司   | 4,396   | 430,851.96   | 0.12 |
| 32 | 000960 | 锡业股份   | 27,800  | 391,980.00   | 0.11 |
| 33 | 300003 | 乐普医疗   | 16,500  | 379,005.00   | 0.11 |
| 34 | 002311 | 海大集团   | 6,100   | 376,553.00   | 0.11 |
| 35 | 688111 | 金山办公   | 1,377   | 364,202.73   | 0.10 |
| 36 | 600581 | 八一钢铁   | 89,600  | 354,816.00   | 0.10 |
| 37 | 601868 | 中国能建   | 153,800 | 352,202.00   | 0.10 |
| 38 | 688002 | 睿创微纳   | 9,151   | 340,325.69   | 0.10 |
| 39 | 600835 | 上海机电   | 29,600  | 332,112.00   | 0.09 |
| 40 | 300207 | 欣旺达    | 13,700  | 289,755.00   | 0.08 |
| 41 | 688116 | 天奈科技   | 3,572   | 275,544.08   | 0.08 |
| 42 | 601136 | 首创证券   | 4,739   | 82,553.38    | 0.02 |
| 43 | 00960  | 龙湖集团   | 2,000   | 43,412.92    | 0.01 |
| 44 | 603899 | 晨光股份   | 300     | 16,494.00    | 0.00 |
| 45 | 603298 | 杭叉集团   | 500     | 8,405.00     | 0.00 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 本期累计买入金额     | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|--------------|----------------|
| 1  | 00883  | 中国海洋石油 | 5,391,815.05 | 1.53           |
| 2  | 601225 | 陕西煤业   | 4,505,470.00 | 1.28           |
| 3  | 601857 | 中国石油   | 3,058,156.00 | 0.87           |
| 4  | 01898  | 中煤能源   | 2,959,594.19 | 0.84           |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 5  | 002142 | 宁波银行 | 2,879,729.00 | 0.82 |
| 6  | 03690  | 美团-W | 2,738,486.33 | 0.78 |
| 7  | 601899 | 紫金矿业 | 2,513,689.00 | 0.71 |
| 8  | 000001 | 平安银行 | 2,317,767.00 | 0.66 |
| 9  | 000858 | 五粮液  | 2,143,120.00 | 0.61 |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 1,957,864.00 | 0.56 |
| 11 | 000933 | 神火股份 | 1,862,459.00 | 0.53 |
| 12 | 601001 | 晋控煤业 | 1,813,222.00 | 0.51 |
| 13 | 000983 | 山西焦煤 | 1,790,456.00 | 0.51 |
| 14 | 600348 | 华阳股份 | 1,581,727.00 | 0.45 |
| 15 | 00700  | 腾讯控股 | 1,518,289.90 | 0.43 |
| 16 | 00753  | 中国国航 | 1,492,427.77 | 0.42 |
| 17 | 600519 | 贵州茅台 | 1,462,731.00 | 0.42 |
| 18 | 601318 | 中国平安 | 1,445,558.00 | 0.41 |
| 19 | 601666 | 平煤股份 | 1,439,946.00 | 0.41 |
| 20 | 600460 | 士兰微  | 1,437,120.00 | 0.41 |

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 本期累计卖出金额     | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|--------------|----------------|
| 1  | 002142 | 宁波银行   | 2,800,143.00 | 0.79           |
| 2  | 000933 | 神火股份   | 2,044,067.00 | 0.58           |
| 3  | 601899 | 紫金矿业   | 1,958,454.00 | 0.56           |
| 4  | 00700  | 腾讯控股   | 1,593,211.14 | 0.45           |
| 5  | 300979 | 华利集团   | 1,331,025.00 | 0.38           |
| 6  | 03993  | 洛阳钼业   | 1,248,194.91 | 0.35           |
| 7  | 03690  | 美团-W   | 1,201,315.85 | 0.34           |
| 8  | 02269  | 药明生物   | 1,189,731.20 | 0.34           |
| 9  | 00388  | 香港交易所  | 1,082,959.88 | 0.31           |
| 10 | 603899 | 晨光股份   | 1,009,072.00 | 0.29           |
| 11 | 600938 | 中国海油   | 983,558.00   | 0.28           |
| 12 | 600779 | 水井坊    | 875,947.00   | 0.25           |
| 13 | 688311 | 盟升电子   | 789,384.40   | 0.22           |
| 14 | 600150 | 中国船舶   | 640,592.00   | 0.18           |
| 15 | 00883  | 中国海洋石油 | 474,768.48   | 0.13           |
| 16 | 688012 | 中微公司   | 448,698.65   | 0.13           |
| 17 | 002531 | 天顺风能   | 430,632.00   | 0.12           |
| 18 | 00753  | 中国国航   | 420,782.30   | 0.12           |
| 19 | 601868 | 中国能建   | 376,298.00   | 0.11           |
| 20 | 00688  | 中国海外发展 | 370,284.31   | 0.11           |

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

## 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 74,106,737.60 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 22,918,764.56 |

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 20,556,264.08  | 5.83         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 195,534,196.15 | 55.49        |
|    | 其中：政策性金融债 | 30,764,219.18  | 8.73         |
| 4  | 企业债券      | 40,681,930.41  | 11.54        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 29,810,603.90  | 8.46         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 286,582,994.54 | 81.33        |

## 8.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码    | 债券名称         | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|--------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 210207  | 21 国开 07     | 300,000 | 30,764,219.18 | 8.73         |
| 2  | 1828015 | 18 招商银行二级 01 | 300,000 | 30,602,473.97 | 8.68         |
| 3  | 132015  | 18 中油 EB     | 208,010 | 22,002,232.10 | 6.24         |
| 4  | 1920046 | 19 宁波银行二级    | 200,000 | 20,753,676.71 | 5.89         |
| 5  | 1828007 | 18 浦发银行二级 01 | 200,000 | 20,590,212.60 | 5.84         |

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 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。

## 8.10 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

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作为交易标的。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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，被处以罚款 440 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国家开发银行债券进行了投资。

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。

2022 年 8 月 31 日，招商银行收到中国人民银行出具的行政处罚决定书（银罚决字（2022）1 号），其因违反账户管理规定、违反清算管理规定等违法违规行为，被处以没收违法所得 5.692641 万元、罚款 3423.5 万元的行政处罚。

2022 年 9 月 9 日，招商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）48 号），其因个人经营贷款挪用至房地产市场、个人经营贷款“三查”不到位、总行对分支机构管控不力承担管理责任等违法违规行为，被处以罚款人民币 460 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。

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，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，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，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，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，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。

2022 年 3 月 21 日，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”，股票代码：600000）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）25 号），其因漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据、漏报贸易融资业务 EAST 数据等违法违规行为，被处以罚款人民币 420 万元。

2022 年 9 月 17 日，浦发银行收到国家外汇管理局上海分局出具的行政处罚决定书（上海汇管罚决字（2022）3111220601 号），其因违规办理远期结汇业务、违规办理期权交易等违法违规行为被处罚。

2022 年 8 月，浦发银行收到上海市市场监管局发布的处罚（沪市监总处（2022）322021000345 号）。

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浦发银行进行了投资。

2022 年 3 月 21 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。

2022 年 2 月 15 日，美团因未依法履行职责被成都市锦江区综合执法局处罚。

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美团进行了投资。

中国国际航空股份有限公司（以下简称“中国国航”，股票代码：601111.SH、0753.HK），于 2022 年 1 月 13 日被中国民用航空局处以罚款。

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国国航进行了投资。

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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额        |
|----|-------|-----------|
| 1  | 存出保证金 | 19,571.85 |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | -         |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 19,571.85 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1  | 132015 | 18 中油 EB | 22,002,232.10 | 6.24         |
| 2  | 110053 | 苏银转债     | 4,367,211.55  | 1.24         |

|   |        |      |              |      |
|---|--------|------|--------------|------|
| 3 | 113044 | 大秦转债 | 3,088,939.89 | 0.88 |
| 4 | 128048 | 张行转债 | 352,220.36   | 0.10 |

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别           | 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构      |                   |                |                       |
|----------------|--------------|---------------|------------|-------------------|----------------|-----------------------|
|                |              |               | 机构投资者      |                   | 个人投资者          |                       |
|                |              |               | 持有份额       | 占总份<br>额比例<br>(%) | 持有份额           | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) |
| 景顺长城安瑞<br>混合 A | 2,092        | 126,096.26    | 297,751.67 | 0.11              | 263,495,619.93 | 99.89                 |
| 景顺长城安瑞<br>混合 C | 1,238        | 71,002.11     | 85,000     | 0.10              | 87,815,609.99  | 99.90                 |
| 合计             | 3,330        | 105,613.81    | 382,751.67 | 0.11              | 351,311,229.92 | 99.89                 |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别       | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|------------|-----------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 景顺长城安瑞混合 A | 4,995.05  | 0.001894    |
|                  | 景顺长城安瑞混合 C | 1,058.82  | 0.001205    |
|                  | 合计         | 6,053.87  | 0.001721    |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末基金的基金经理未持有本基金。

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 景顺长城安瑞混合 A     | 景顺长城安瑞混合 C    |
|--------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2022 年 9 月 23 日）基金份额总额 | 267,185,948.11 | 94,044,910.33 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额          | 9.99           | 209.63        |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额        | 3,392,586.50   | 6,144,509.97  |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额         | -              | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 263,793,371.60 | 87,900,609.99 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

本基金管理人于 2022 年 12 月 6 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任康乐先生担任本公司财务负责人。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 1 年为本基金提供审

计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 50,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 交易单元数量 | 股票交易          |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|--------------|--------|---------------|------------------|-----------|----------------|----|
|              |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 兴业证券股份有限公司   | 2      | 96,957,406.05 | 100.00           | 86,383.17 | 100.00         | -  |
| 山西证券股份有限公司   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 中信建投证券股份有限公司 | 3      | -             | -                | -         | -              | -  |

注：1、本基金与景顺长城景丰货币市场基金共用交易单元。

2、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序



基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 债券交易           |                  | 债券回购交易         |                    | 权证交易 |                  |
|--------------|----------------|------------------|----------------|--------------------|------|------------------|
|              | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额           | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 兴业证券股份有限公司   | 170,416,519.54 | 100.00           | 451,816,000.00 | 100.00             | -    | -                |
| 山西证券股份有限公司   | -              | -                | -              | -                  | -    | -                |
| 中信建投证券股份有限公司 | -              | -                | -              | -                  | -    | -                |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                             | 法定披露方式       | 法定披露日期     |
|----|----------------------------------|--------------|------------|
| 1  | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金托管协议              | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022年6月17日 |
| 2  | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金招募说明书             | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022年6月17日 |
| 3  | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金产品资料概要          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022年6月17日 |
| 4  | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金份额发售公告          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022年6月17日 |
| 5  | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022年6月17日 |
| 6  | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金合同              | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022年6月17日 |
| 7  | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022年6月24日 |
| 8  | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022年7月15日 |
| 9  | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022年7月29日 |
| 10 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022年8月6日  |
| 11 | 景顺长城基金管理有限公司关于开通交通银行借记卡直销网上交易业务及 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022年8月25日 |

|    |  |              |                  |
|----|--|--------------|------------------|
|    | 费率优惠的公告                                      |              |                  |
| 12 | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金新增兴业银行等多家公司为销售机构的公告           | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 8 月 26 日  |
| 13 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机升级的公告                      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 8 月 27 日  |
| 14 | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金新增蚂蚁基金等多家公司为销售机构的公告           | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 8 月 27 日  |
| 15 | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金新增中国工商银行等多家公司为销售机构的公告         | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 8 月 30 日  |
| 16 | 关于网络平台冒用“景顺长城基金”及员工名义进行不法活动的澄清公告             | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 8 月 31 日  |
| 17 | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金新增嘉兴银行等多家公司为销售机构的公告           | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 8 月 31 日  |
| 18 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 9 月 2 日   |
| 19 | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金新增中国农业银行为销售机构的公告              | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 9 月 2 日   |
| 20 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 9 月 9 日   |
| 21 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 9 月 16 日  |
| 22 | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金新增中国建设银行为销售机构的公告              | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 9 月 16 日  |
| 23 | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金新增肯特瑞为销售机构的公告                 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 9 月 21 日  |
| 24 | 关于景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金合同生效的公告                   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 9 月 24 日  |
| 25 | 景顺长城基金管理有限公司关于公司固有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告       | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 10 月 18 日 |
| 26 | 景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示                  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 10 月 31 日 |
| 27 | 景顺长城基金管理有限公司关于暂停武汉市伯嘉基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 10 月 31 日 |
| 28 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 11 月 5 日  |
| 29 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 11 月 18 日 |
| 30 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下                             | 中国证监会指定报刊及   | 2022 年 12 月 2 日  |

|    |  |              |                  |
|----|--|--------------|------------------|
|    | 部分基金新增博时财富为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告 | 网站           |                  |
| 31 | 景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员（财务负责人）变更公告                        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 12 月 6 日  |
| 32 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                                    | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 12 月 16 日 |
| 33 | 关于景顺长城安瑞混合型证券投资基金参加部分销售机申购及/或定期定额投资申购费率优惠活动的公告             | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 12 月 20 日 |
| 34 | 景顺长城安瑞混合型证券投资基金关于开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告                  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 12 月 20 日 |
| 35 | 景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城安瑞混合型证券投资基金在直销网上交易系统开展申购、定投和转换费率优惠活动的公告  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 12 月 20 日 |
| 36 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告              | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 12 月 22 日 |
| 37 | 关于旗下部分基金参加东莞农村商业银行股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告             | 中国证监会指定报刊及网站 | 2022 年 12 月 30 日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城安瑞混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城安瑞混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城安瑞混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城安瑞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。

### 13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 13.3 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

2023 年 3 月 28 日