

# 景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资 基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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：2021 年 10 月 27 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 2021 年 10 月 26 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 2021 年 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	景顺长城泰安回报混合
场内简称	无
基金主代码	003603
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 9 日
报告期末基金份额总额	510,032,552.05 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</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>

	3、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，筛选出价值优势明显的优质股票构建股票投资组合。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。	
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×70% + 沪深 300 指数收益率×30%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高预期收益和风险水平的投资品种，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	景顺长城泰安回报混合 A 类	景顺长城泰安回报混合 C 类
下属分级基金的交易代码	003603	003604
报告期末下属分级基金的份额总额	383,082,718.48 份	126,949,833.57 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（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）	
	景顺长城泰安回报混合 A 类	景顺长城泰安回报混合 C 类
1. 本期已实现收益	10,949,771.96	3,046,385.97
2. 本期利润	4,844,199.40	1,186,850.49
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0124	0.0105
4. 期末基金资产净值	499,632,924.76	164,628,350.14
5. 期末基金份额净值	1.3042	1.2967

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城泰安回报混合 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	①—③	②—④

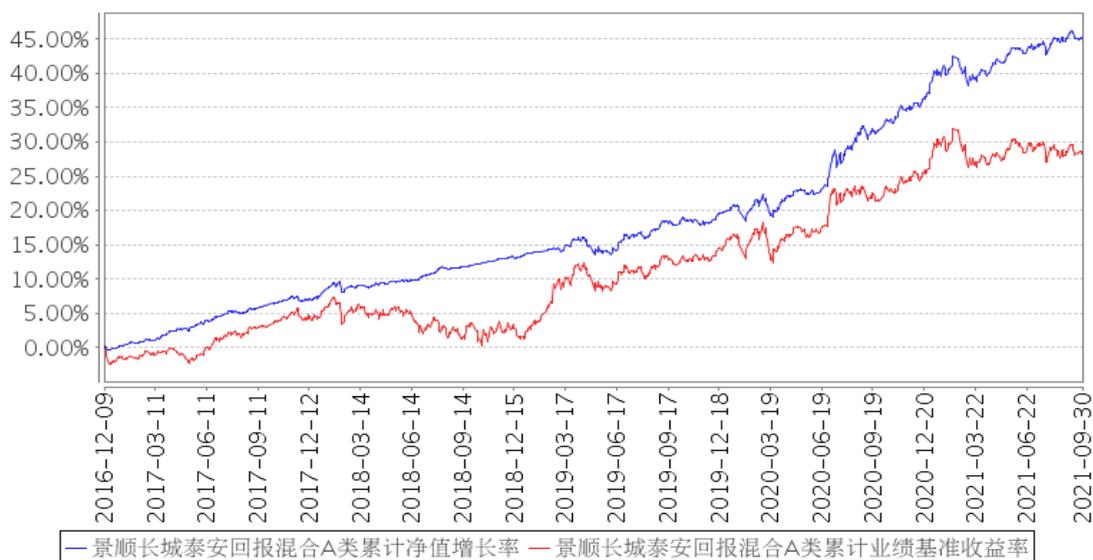
				④		
过去三个月	0.95%	0.24%	-0.85%	0.36%	1.80%	-0.12%
过去六个月	3.82%	0.21%	1.10%	0.33%	2.72%	-0.12%
过去一年	10.31%	0.26%	5.85%	0.37%	4.46%	-0.11%
过去三年	29.78%	0.25%	24.08%	0.40%	5.70%	-0.15%
自基金合同 生效起至今	45.34%	0.20%	28.60%	0.36%	16.74%	-0.16%

景顺长城泰安回报混合 C 类

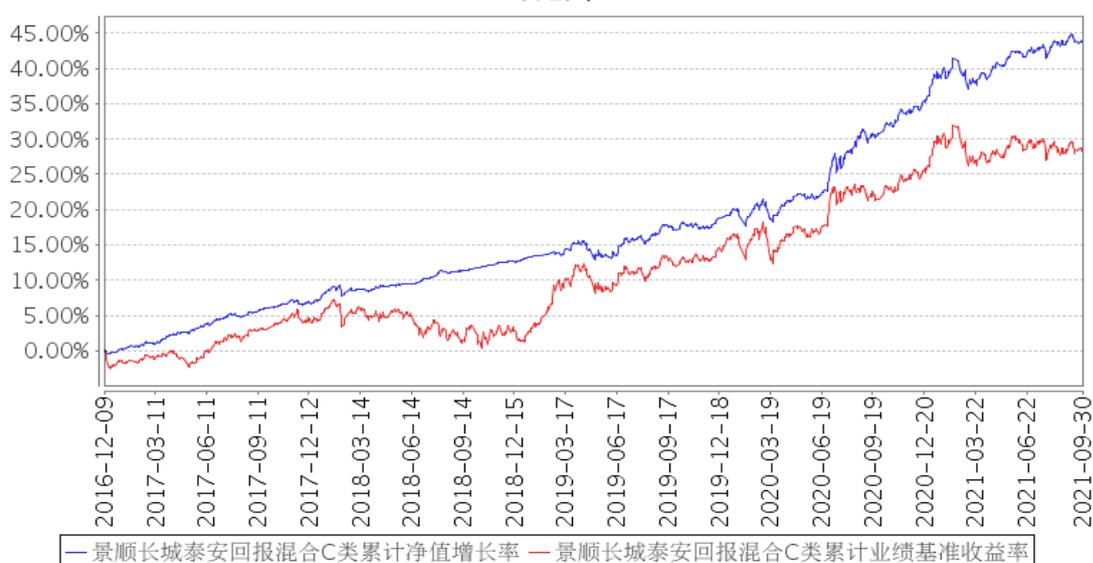
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.24%	-0.85%	0.36%	1.74%	-0.12%
过去六个月	3.71%	0.21%	1.10%	0.33%	2.61%	-0.12%
过去一年	10.09%	0.26%	5.85%	0.37%	4.24%	-0.11%
过去三年	29.01%	0.25%	24.08%	0.40%	4.93%	-0.15%
自基金合同 生效起至今	43.96%	0.20%	28.60%	0.36%	15.36%	-0.16%

### 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

景顺长城泰安回报混合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



景顺长城泰安回报混合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：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货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。本基金的建仓期为自 2016 年 12 月 9 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		
万梦	本基金的基金经理	2016年12月9日	2021年8月30日	10年	工学硕士。曾任职于壳牌（中国）有限公司。2011年9月加入本公司，历任研究部行业研究员、固定收益部研究员、基金经理助理，自2015年7月起担任固定收益部基金经理。具有10年证券、基金行业从业经验。
陈莹	本基金的基金经理	2020年7月25日	-	7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，历任固定收益部信用研究员、基金经理助理，自2020年7月起担任固定收益部基金经理。具有7年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城泰安回报灵活配置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 4 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

2021 年三季度经济增速放缓迹象更为明显。出口数据仍保持韧劲，8 月份当月出口同比增速保持 25.6% 的正增长，而内需相对疲软：受局部疫情反复、居民收入恢复偏慢的影响，8 月份社会消费品零售同比增速为 2.5%，增速环比回落 6 个百分点。而房地产销售、投资走弱的趋势在 7、8 月份也开始显现，8 月份房地产销售面积同比下滑 15%，单月房地产开发投资增速也接近零增长。与此同时，进入 8 月份以后，出现了缺煤、缺电的新情况，9 月份拉闸限电的现象时有发生，而在供需的共同作用下，海外也出现包括天然气、煤炭等在内的能源价格大幅飙升的情况。在经济增速有所放缓的大背景下，对于全球经济出现滞胀的担忧有所上升。

债券市场方面，受央行在 7 月 9 号降准的影响，资金面持续宽松，债券收益率在 7 月份加速下行，进入 8 月份后转为震荡。整个三季度，10 年期国开债收益率回落约 20bp，1 年期国开债收益率回落 10BP，收益率曲线有所扁平化。

权益市场方面，指数先回落后反弹，上证指数三季度基本收平，但行业继续分化：受产品价格涨价以及调价预期的带动，煤炭、电力、钢铁等行业表现突出，而医药以及与消费相关的行业和个股表现较为落后。上证指数当季回落 0.64%，沪深 300 下跌 6.85%，创业板指跌 6.69%。

三季度组合债券部分主要立足票息策略，整体维持中短久期，适度提高了杠杆水平。权益部分以绝对收益为主要思路，结构上以景气度确定性强、估值相对合理的核心资产为主，增配一部分稳健低估值品种。

展望四季度，从经济基本面看，消费不振或将持续一段时间，而地产行业进入下行周期已基本确认，中国经济短期内暂难进入上升趋势。但从政策层面来看，信用政策进一步收紧的可能性很低，而部分过于紧缩的政策，尤其与房地产相关的政策或存在适度调整的空间，边际宽信用，社融逐步企稳。因此，前瞻的看，经济出现大幅失速下滑的风险并不大。

债券市场方面，我们从前期相对乐观的态度转为中性，组合将维持中低久期，立足票息策略，待收益率调整之后择机增配长债。

权益市场方面，当前宏观场景制约权益市场整体估值提升带来的趋势性机会，宏观经济运行情况、政策的边际变化、通胀预期等是影响当前市场走势的核心矛盾，对此应保持高度关注，需要进行紧密跟踪。我们对后市观点偏中性：一方面，中国经济增长惯性仍在，且预计政策面将相机而动（存在政策空间），国内经济快速回落的风险并不大；另一方面，第三季度的流动性维持超预期宽松，市场分化到极致，高景气度的赛道股、部分上游原材料相关标的经历了大幅的上涨，存在一定的估值风险，预期未来市场仍会有较大波动。配置思路方面，积极寻找中长期景气度较高且估值已经回归相对合理的板块和个股的配置机会，逢低吸纳代表消费升级及产业升级趋势的优质龙头，择机适度增加对宏观风险已经较为充分定价的行业和个股的配置。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2021 年 3 季度，景顺长城泰安回报混合 A 份额净值增长率为 0.95%，业绩比较基准收益率为 -0.85%。

2021 年 3 季度，景顺长城泰安回报混合 C 份额净值增长率为 0.89%，业绩比较基准收益率为 -0.85%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	128,992,745.75	16.50
	其中：股票	128,992,745.75	16.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	628,683,888.25	80.43
	其中：债券	618,654,888.25	79.15
	资产支持证券	10,029,000.00	1.28
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	7,600,131.40	0.97
	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	3,192,578.47	0.41
8	其他资产	13,170,429.61	1.68
9	合计	781,639,773.48	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	12,350.52	0.00
B	采矿业	4,756,594.00	0.72
C	制造业	77,203,016.66	11.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,607,000.00	0.39
E	建筑业	20,183.39	0.00
F	批发和零售业	1,494,947.71	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	5,110,247.00	0.77
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,073,215.81	0.31
J	金融业	28,917,460.60	4.35
K	房地产业	916,159.00	0.14
L	租赁和商务服务业	2,262,804.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	3,071,024.94	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	38,613.78	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	501,858.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	3,925.22	0.00
S	综合	-	-
	合计	128,992,745.75	19.42

## 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

## 5.3.1 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	213,300	7,497,495.00	1.13
2	600036	招商银行	113,100	5,705,895.00	0.86
3	600519	贵州茅台	2,700	4,941,000.00	0.74
4	000333	美的集团	60,325	4,198,620.00	0.63
5	000001	平安银行	227,400	4,077,282.00	0.61
6	000858	五粮液	16,500	3,619,935.00	0.54
7	002311	海大集团	52,100	3,511,540.00	0.53
8	603806	福斯特	22,760	2,885,968.00	0.43
9	600377	宁沪高速	321,800	2,806,096.00	0.42

10	300207	欣旺达	72,100	2,696,540.00	0.41
----	--------	-----	--------	--------------	------

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

无。

### 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	60,148,000.00	9.05
	其中：政策性金融债	40,066,000.00	6.03
4	企业债券	140,855,000.00	21.20
5	企业短期融资券	20,062,000.00	3.02
6	中期票据	335,799,000.00	50.55
7	可转债（可交换债）	229,888.25	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	61,561,000.00	9.27
10	合计	618,654,888.25	93.13

### 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	155776	19 东风 03	300,000	30,195,000.00	4.55
2	101460044	14 宿产发 MTN001	200,000	20,678,000.00	3.11
3	1928009	19 农业银行二级 04	200,000	20,546,000.00	3.09
4	101901472	19 泉州城建 MTN001	200,000	20,334,000.00	3.06
5	101900128	19 溧水城建 MTN002	200,000	20,244,000.00	3.05

### 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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	137104	中借 04A	100,000	10,029,000.00	1.51

### 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，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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

1、中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”，股票代码：601288、1288.HK）于 2020 年 12 月 7 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（2020）66 号）。其因收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费）等问题，违反了《中华人民共和国商业银行法》第五十条、《关于银行业金融机构免除部分服务收费的通知》第一条和《中华人民共和国商业银行法》第七十三条的相关规定，被处以没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万元，罚没金额合计 198.36 万元。

2021 年 1 月 19 日，农业银行因发生重要信息系统突发事件未报告、制卡数据违规明文留存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、第四十六条第五项和相关审慎经营规则，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（2021）1 号），被处以罚款合计 420 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农业银行进行了投资。

2、宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”，股票代码：002142）于 2020 年 10 月 16 日收到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局出具的行政处罚决定书（甬银保监罚决字（2020）48 号）。其因授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位等问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条的规定，被处以罚款人民币 30 万元。

2021 年 6 月 10 日，宁波银行因代理销售保险不规范，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、第四十八条第（一）项的相关规定，收到宁波银保监局出具的行政处罚决定书（甬银保监罚决字（2021）36 号），被处以罚款人民币 25 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

2021 年 7 月 30 日，宁波银行因贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储、开发贷款支用审核不严、房地产贷款放款和支用环节审核不严、贷款资金违规流入房市、房地产贷款资金回流借款人、票据业务开展不审慎，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条的规定，收到宁波银保监局出具的行政处罚决定书（甬银保监罚决字（2021）57 号），被处以罚款人民币 275 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

2021 年 7 月 13 日，宁波银行因违规为存款人多头开立银行结算账户、超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料等，收到中国人民银行宁波市中心支行出具的行政处罚决定书（甬银处罚字（2021）2 号），被给予警告，并处罚款 286.2 万元。

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。

3、招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，股票代码：600036）于 2021 年 5 月 17 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（2021）16 号）。其因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品、理财产品之间风险隔离不到位等二十七项违法违规事实，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，被处以罚款 7170 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。

4、平安银行于 2020 年 10 月 16 日收到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局出具的行政处罚决定书(甬银保监罚决字(2020)66号)。其因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条的规定，被处以 100 万元罚款。

2021 年 5 月 28 日，平安银行收到中国银保监会云南监管局出具的行政处罚决定书(云银保监罚决字(2021)34号)，其因利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险等违法违规事实，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项相关规定，被处以罚款人民币 210 万元。

2021 年 5 月 10 日，平安银行资金运营中心收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书(沪银保监罚决字(2021)55号)，其因违规向未取得土地使用权证的房地产项目提供融资等违法违规事实，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项相关规定，被处以罚款人民币 300 万元。

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。

5、其余六名证券的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	47,649.06
2	应收证券清算款	1,585,164.06
3	应收股利	-
4	应收利息	11,427,702.43
5	应收申购款	109,914.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,170,429.61

### 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	123064	万孚转债	10,093.72	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	景顺长城泰安回报混合 A 类	景顺长城泰安回报混合 C 类
报告期期初基金份额总额	420,071,565.83	109,204,683.39
报告期期间基金总申购份额	5,728,118.97	33,124,820.46
减：报告期期间基金总赎回份额	42,716,966.32	15,379,670.28
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	383,082,718.48	126,949,833.57

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

机	1	20210701-20210930	191,155,078.53	-	-	191,155,078.53	37.48
构	2	20210701-20210930	226,924,846.84	24,134,289.28	39,264,382.44	211,794,753.68	41.53
产品特有风险							
<p>本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：</p> <p>1、大额申购风险</p> <p>在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>(4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p> <p>(5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；</p> <p>(6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p> <p>本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。</p>							

## 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泰安回报灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城泰安回报灵活配置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

2021 年 10 月 27 日