

景顺长城景颐双利债券型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 19 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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 18 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 2024 年 4 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 景顺长城景颐双利债券 |
| 场内简称 | 无 |
| 基金主代码 | 000385 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013 年 11 月 13 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 10,368,208,225.41 份 |
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于固定收益品种，在有效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：本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会，根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略：</p> <p>债券类属资产配置：基金管理人根据国债、金融债、企业（公司）债、分离交易可转债债券部分等品种与同期限国债或央票之间收益率利差的扩大和收窄的分析，主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。</p> <p>债券投资策略：债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极</p> |

| | | |
|-----------------|--|------------------|
| | 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。 资产支持证券投资策略：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。同时，管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。 | |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款利率（税后）+1.5%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 北京银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 景顺长城景颐双利债券 A 类 | 景顺长城景颐双利债券 C 类 |
| 下属分级基金的交易代码 | 000385 | 000386 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 9,777,445,133.72 份 | 590,763,091.69 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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|----------------|
| | 景顺长城景颐双利债券 A 类 | 景顺长城景颐双利债券 C 类 |
| 1. 本期已实现收益 | 186,126,330.39 | 9,972,480.13 |
| 2. 本期利润 | 228,641,476.41 | 11,842,266.02 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0250 | 0.0216 |
| 4. 期末基金资产净值 | 16,129,071,251.63 | 934,309,508.97 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.650 | 1.582 |

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城景颐双利债券 A 类

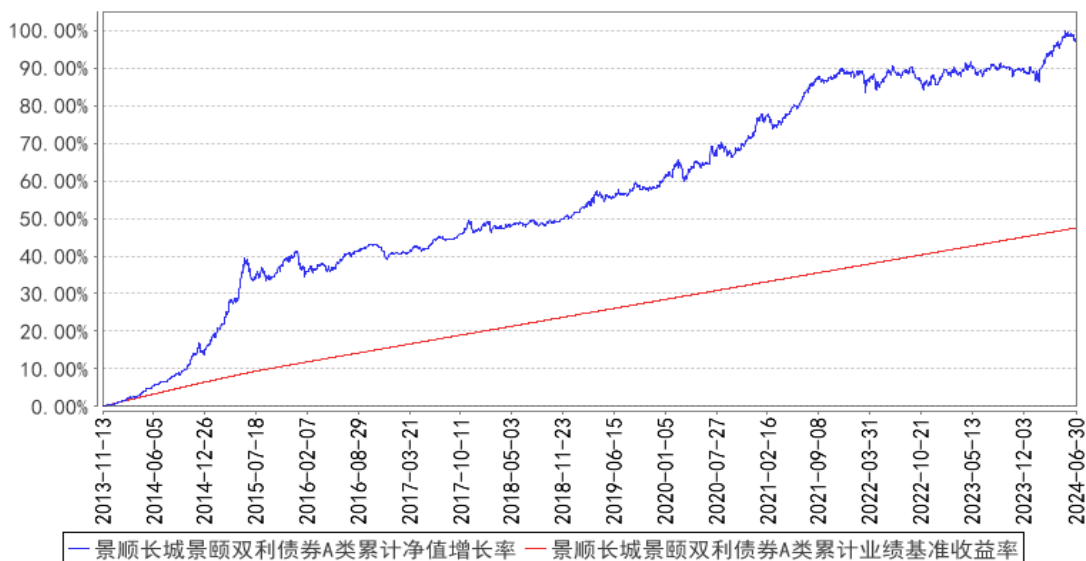
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.73% | 0.23% | 0.72% | 0.01% | 1.01% | 0.22% |
| 过去六个月 | 4.10% | 0.26% | 1.45% | 0.01% | 2.65% | 0.25% |
| 过去一年 | 4.70% | 0.22% | 2.97% | 0.01% | 1.73% | 0.21% |
| 过去三年 | 9.14% | 0.23% | 9.47% | 0.01% | -0.33% | 0.22% |
| 过去五年 | 26.25% | 0.24% | 16.84% | 0.01% | 9.41% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 97.96% | 0.24% | 47.49% | 0.01% | 50.47% | 0.23% |

景顺长城景颐双利债券 C 类

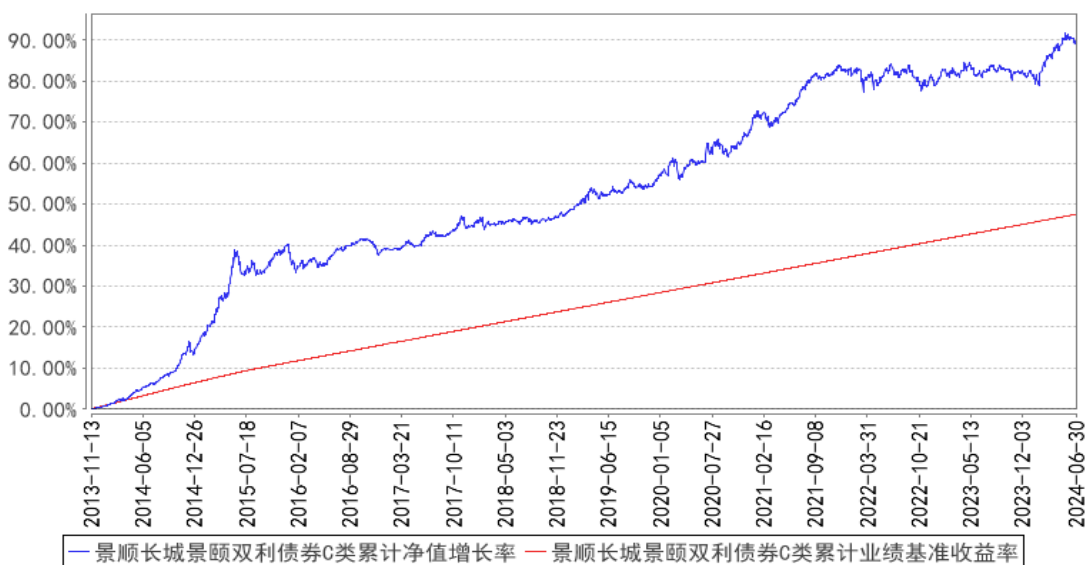
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.61% | 0.23% | 0.72% | 0.01% | 0.89% | 0.22% |
| 过去六个月 | 3.94% | 0.26% | 1.45% | 0.01% | 2.49% | 0.25% |
| 过去一年 | 4.28% | 0.21% | 2.97% | 0.01% | 1.31% | 0.20% |
| 过去三年 | 7.87% | 0.23% | 9.47% | 0.01% | -1.60% | 0.22% |
| 过去五年 | 23.78% | 0.24% | 16.84% | 0.01% | 6.94% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 89.76% | 0.24% | 47.49% | 0.01% | 42.27% | 0.23% |

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

景顺长城景颐双利债券A类累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城景颐双利债券C类累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2013 年 11 月 13 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 | | |
| 董晗 | 本基金的基金经理 | 2020 年 10 月 30 日 | - | 18 年 | 理学硕士。曾任易方达基金管理有限公司研究部研究员，国投瑞银基金管理有限公司研究部研究员、投资部基金经理。2020 年 7 月加入本公司，自 2020 年 10 月起担任股票投资部基金经理，现任股票投资部总监、基金经理。具有 18 年证券、基金行业从业经验。 |
| 李怡文 | 本基金的基金经理 | 2021 年 4 月 30 日 | - | 18 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 18 年证券、基金行业从业经验。 |
| 郭杰 | 本基金的基金助理 | 2021 年 12 月 17 日 | - | 9 年 | 金融硕士。曾任太平财产保险有限公司财务部预算审批专员，前海开源基金管理有限公司交易部债券交易员。2016 年 3 月加入本公司，历任交易管理部交易员、固定收益部研究员、基金经理助理，自 2022 年 11 月起担任固定收益部基金经理。具有 9 年证券、基金行业从业经验。 |

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城景颐双利债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，

在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 3 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

今年以来，我国经济总体仍在曲折修复的过程中，在一季度实现了较为强劲的开局之后，二季度边际有所走弱。具体看来，制造业 PMI 在 1~2 月处于荣枯线以下低位震荡后，3~4 月分别录得 50.8 和 50.4，5~6 月又回落至荣枯线以下。消费延续温和修复，但在结构性产能过剩的背景下，总体价格仍面临一定压力；固定资产投资韧性较强，主要是制造业投资延续亮眼表现，地产投资仍在回落通道中，基建投资逐月下滑；出口受益于全球制造业复苏而较为强劲。海外方面，在韧性较强的增长数据和回落节奏较慢的通胀数据影响下，美联储降息指引波动较大，市场对联储降息预期大幅后移。市场表现方面，上半年债券表现最好，其次是转债，再者是股票。债券收益率震荡下行，长端表现突出，30 年国债收益率今年以来创出历史新低后保持低位震荡；股市走势整体跟随经济修复节奏，今年一季度遭遇流动性冲击后，上证指数重新站上 3000 点，二季度走势总体震荡；转债则在相对较高的债底保护下，调整幅度总体小于股票。操作方面，债券久期总体保持在中性左右的水平，信用债逢高配置 1~3 年高等级；转债方面，我们在 2 月份市场受到冲击的情况下，适度增加了转债资产的配置，标的仍然以正股和转债估值稳健的个券为主；股票方面，基本维持中高仓位，继续超配上游的能源和有色板块，同时适度均衡。

展望后市，我们认为经济总体仍在回归潜在增长中枢的过程中，三季度环比二季度改善。首先，投资有望发力。5 月以来专项债发行有所加快，预计下半年会明显提速，并带动银行配套信

贷投放，形成实物工作量，进而带动物价温和回升；地产投资方面，“607”国常会提出“继续研究储备新的去库存、稳市场政策措施”，稳地产政策有望持续出台。此外，国务院发布的《推动大规模设备更新和消费品以旧换新行动方案》等支持性政策有望带动设备投资延续高增速。其次，消费意愿提升有望带动消费向上修复。尽管前期房价环比的加速下行对居民的消费意愿有所抑制，但后续随着财政力度的边际扩大，居民就业和收入有望边际改善，进而带动消费修复；再者，出口在海外库存周期回升和新兴市场需求改善的背景下有望保持平稳。海外方面，美联储 6 月 FOMC 决议将基准利率维持在 5.25%-5.5%，点阵图将 2024 年降息次数从 3 次下调至 1 次。美国经济数据总体保持高韧性但也有边际走弱的迹象出现，5 月偏弱的 CPI 数据有助于增强对通胀回到 2% 的信心。

操作方面，债券部分预期保持中性久期，会加大操作的灵活度；转债方面自下而上关注溢价率合理标的的布局机会；股票方面会继续保持合同约定中高仓位，关注具有核心竞争力且景气程度有望改善的高端制造业以及内需逐步企稳后带来的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2024 年 2 季度，景顺长城景颐双利债券 A 类份额净值增长率为 1.73%，业绩比较基准收益率为 0.72%。

2024 年 2 季度，景顺长城景颐双利债券 C 类份额净值增长率为 1.61%，业绩比较基准收益率为 0.72%。

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 | 2,935,323,756.34 | 15.52 |
| | 其中：股票 | 2,935,323,756.34 | 15.52 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 15,645,167,704.90 | 82.75 |
| | 其中：债券 | 15,645,167,704.90 | 82.75 |
| | 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 | 210,038,876.71 | 1.11 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |

| | | | |
|---|--------------|-------------------|--------|
| | 产 | | |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 73,434,307.72 | 0.39 |
| 8 | 其他资产 | 43,525,133.10 | 0.23 |
| 9 | 合计 | 18,907,489,778.77 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 1,233,571,849.45 | 7.23 |
| C | 制造业 | 1,291,432,274.10 | 7.57 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 34,013,896.00 | 0.20 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 219,213,643.28 | 1.28 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 17,290,492.50 | 0.10 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 139,801,601.01 | 0.82 |
| 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 | 2,935,323,756.34 | 17.20 |

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 | 601225 | 陕西煤业 | 10,741,412 | 276,806,187.24 | 1.62 |
| 2 | 600938 | 中国海油 | 6,280,052 | 207,241,716.00 | 1.21 |
| 3 | 601899 | 紫金矿业 | 11,098,101 | 194,993,634.57 | 1.14 |

| | | | | | |
|----|--------|------|------------|----------------|------|
| 4 | 600489 | 中金黄金 | 11,113,818 | 164,484,506.40 | 0.96 |
| 5 | 600961 | 株冶集团 | 14,947,095 | 141,100,576.80 | 0.83 |
| 6 | 001979 | 招商蛇口 | 15,904,619 | 139,801,601.01 | 0.82 |
| 7 | 300750 | 宁德时代 | 676,279 | 121,750,508.37 | 0.71 |
| 8 | 002371 | 北方华创 | 275,962 | 88,277,484.18 | 0.52 |
| 9 | 603993 | 洛阳钼业 | 10,222,900 | 86,894,650.00 | 0.51 |
| 10 | 688120 | 华海清科 | 448,080 | 84,947,006.40 | 0.50 |

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 | 160,926,629.13 | 0.94 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 6,093,633,872.72 | 35.71 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,134,043,123.39 | 6.65 |
| 4 | 企业债券 | 2,988,369,083.85 | 17.51 |
| 5 | 企业短期融资券 | 90,801,789.79 | 0.53 |
| 6 | 中期票据 | 2,601,900,924.60 | 15.25 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 3,709,535,404.81 | 21.74 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 15,645,167,704.90 | 91.69 |

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 | 110059 | 浦发转债 | 9,226,880 | 1,017,497,604.65 | 5.96 |
| 2 | 113052 | 兴业转债 | 6,030,950 | 652,655,364.30 | 3.82 |
| 3 | 2128025 | 21建设银行二级01 | 3,500,000 | 370,609,262.30 | 2.17 |
| 4 | 1920059 | 19江苏银行二级 | 3,000,000 | 311,069,934.43 | 1.82 |
| 5 | 110073 | 国投转债 | 2,520,640 | 272,833,244.89 | 1.60 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

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 投资组合报告附注

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

中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

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上述主体所发行证券进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 2,179,118.67 |
| 2 | 应收证券清算款 | 39,821,309.61 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,524,704.82 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 43,525,133.10 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------------|--------------|
| 1 | 110059 | 浦发转债 | 1,017,497,604.65 | 5.96 |

| | | | | |
|----|--------|---------|----------------|------|
| 2 | 113052 | 兴业转债 | 652,655,364.30 | 3.82 |
| 3 | 110073 | 国投转债 | 272,833,244.89 | 1.60 |
| 4 | 113050 | 南银转债 | 256,112,791.89 | 1.50 |
| 5 | 110079 | 杭银转债 | 159,534,722.31 | 0.93 |
| 6 | 110075 | 南航转债 | 93,875,829.16 | 0.55 |
| 7 | 113066 | 平煤转债 | 85,105,023.45 | 0.50 |
| 8 | 127085 | 韵达转债 | 78,859,520.76 | 0.46 |
| 9 | 127020 | 中金转债 | 66,279,839.63 | 0.39 |
| 10 | 127056 | 中特转债 | 64,483,502.04 | 0.38 |
| 11 | 127018 | 本钢转债 | 62,036,413.18 | 0.36 |
| 12 | 113633 | 科沃转债 | 60,998,352.11 | 0.36 |
| 13 | 118034 | 晶能转债 | 59,390,003.28 | 0.35 |
| 14 | 113044 | 大秦转债 | 52,588,318.48 | 0.31 |
| 15 | 128135 | 洽洽转债 | 50,589,722.17 | 0.30 |
| 16 | 110085 | 通 22 转债 | 48,280,526.41 | 0.28 |
| 17 | 118024 | 冠宇转债 | 47,193,973.27 | 0.28 |
| 18 | 113055 | 成银转债 | 46,997,303.93 | 0.28 |
| 19 | 123108 | 乐普转 2 | 43,662,967.32 | 0.26 |
| 20 | 110089 | 兴发转债 | 41,482,475.44 | 0.24 |
| 21 | 118030 | 睿创转债 | 39,412,955.07 | 0.23 |
| 22 | 127073 | 天赐转债 | 38,624,313.07 | 0.23 |
| 23 | 113056 | 重银转债 | 34,706,936.99 | 0.20 |
| 24 | 128048 | 张行转债 | 32,984,867.41 | 0.19 |
| 25 | 127086 | 恒邦转债 | 32,274,249.49 | 0.19 |
| 26 | 113053 | 隆 22 转债 | 31,624,010.69 | 0.19 |
| 27 | 113043 | 财通转债 | 28,826,919.94 | 0.17 |
| 28 | 113059 | 福莱转债 | 26,050,392.04 | 0.15 |
| 29 | 113666 | 爱玛转债 | 25,892,735.26 | 0.15 |
| 30 | 127039 | 北港转债 | 22,349,165.95 | 0.13 |
| 31 | 113065 | 齐鲁转债 | 19,072,941.21 | 0.11 |
| 32 | 113675 | 新 23 转债 | 17,858,325.65 | 0.10 |
| 33 | 128134 | 鸿路转债 | 17,668,018.69 | 0.10 |
| 34 | 113021 | 中信转债 | 17,389,800.88 | 0.10 |
| 35 | 111010 | 立昂转债 | 16,003,020.66 | 0.09 |
| 36 | 113655 | 欧 22 转债 | 10,292,429.54 | 0.06 |
| 37 | 123107 | 温氏转债 | 8,596,678.68 | 0.05 |
| 38 | 127032 | 苏行转债 | 6,894,810.30 | 0.04 |
| 39 | 128136 | 立讯转债 | 6,130,204.53 | 0.04 |
| 40 | 127038 | 国微转债 | 5,359,167.23 | 0.03 |
| 41 | 118000 | 嘉元转债 | 3,381,169.13 | 0.02 |
| 42 | 123090 | 三诺转债 | 2,424,040.58 | 0.01 |
| 43 | 128097 | 奥佳转债 | 1,613,848.02 | 0.01 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 44 | 113047 | 旗滨转债 | 1,550,478.12 | 0.01 |
| 45 | 123121 | 帝尔转债 | 1,016,989.46 | 0.01 |
| 46 | 113605 | 大参转债 | 526,056.62 | 0.00 |
| 47 | 127044 | 蒙娜转债 | 391,455.62 | 0.00 |
| 48 | 113641 | 华友转债 | 95,378.99 | 0.00 |
| 49 | 127066 | 科利转债 | 66,546.32 | 0.00 |

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 景顺长城景颐双利债券 A 类 | 景顺长城景颐双利债券 C 类 |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 8,387,317,543.58 | 533,653,534.80 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,346,667,197.26 | 235,586,846.77 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 956,539,607.12 | 178,477,289.88 |
| 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 | 9,777,445,133.72 | 590,763,091.69 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本期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

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城景颐双利债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城景颐双利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城景颐双利债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城景颐双利债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2024 年 7 月 19 日