

景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基  
金  
2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 4 月 22 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 月 19 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 1 月 1 日起至 2024 年 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 景顺长城景兴信用纯债债券  |
| 场内简称       | 无   |
| 基金主代码      | 000252  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2013 年 8 月 26 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 3,706,457,115.35 份  |
| 投资目标       | 本基金主要通过投资于信用债券类资产，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、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、可分离交易可转债的纯债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>3、债券投资策略:债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> |

|                 |  |                  |                  |
|-----------------|--|------------------|------------------|
|                 | <p>4、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,并通过研究标的的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的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。</p> <p>5、中小企业私募债投资策略:对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面,本基金将加强自下而上的分析,将机构评级与内部评级相结合,着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力,尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。</p> |                  |                  |
| 业绩比较基准          | 中证综合债券指数。  |                  |                  |
| 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           | 中国建设银行股份有限公司   |                  |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 景顺长城景兴信用纯债债券 A 类   | 景顺长城景兴信用纯债债券 C 类 | 景顺长城景兴信用纯债债券 F 类 |
| 下属分级基金的交易代码     | 000252   | 000253           | 020995           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 3,678,587,095.48 份   | 27,789,109.07 份  | 80,910.80 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1月1日-2024年3月31日) |                  | 报告期(2024年3月15日-2024年3月31日) |
|-----------------|---------------------------|------------------|----------------------------|
|                 | 景顺长城景兴信用纯债债券 A 类          | 景顺长城景兴信用纯债债券 C 类 | 景顺长城景兴信用纯债债券 F 类           |
| 1. 本期已实现收益      | 26,218,874.16             | 167,983.62       | 38.59                      |
| 2. 本期利润         | 49,733,490.06             | 361,848.55       | 97.89                      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0157                    | 0.0151           | 0.0048                     |
| 4. 期末基金资产净值     | 4,338,228,241.50          | 32,644,442.43    | 95,478.89                  |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1793                    | 1.1747           | 1.1801                     |

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

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

3、本基金自 2024 年 3 月 14 日起增设 F 类基金份额，并于 2024 年 3 月 15 日开始对 F 类份额进行估值。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城景兴信用纯债债券 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      | 1.42%  | 0.05%     | 2.09%      | 0.07%         | -0.67% | -0.02% |
| 过去六个月      | 2.65%  | 0.04%     | 3.45%      | 0.06%         | -0.80% | -0.02% |
| 过去一年       | 4.58%  | 0.05%     | 6.02%      | 0.06%         | -1.44% | -0.01% |
| 过去三年       | 10.08% | 0.05%     | 15.24%     | 0.05%         | -5.16% | 0.00%  |
| 过去五年       | 14.94% | 0.05%     | 23.70%     | 0.06%         | -8.76% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 53.91% | 0.08%     | 61.86%     | 0.07%         | -7.95% | 0.01%  |

景顺长城景兴信用纯债债券 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      | 1.33%  | 0.05%     | 2.09%      | 0.07%         | -0.76%  | -0.02% |
| 过去六个月      | 2.67%  | 0.05%     | 3.45%      | 0.06%         | -0.78%  | -0.01% |
| 过去一年       | 4.40%  | 0.05%     | 6.02%      | 0.06%         | -1.62%  | -0.01% |
| 过去三年       | 9.02%  | 0.05%     | 15.24%     | 0.05%         | -6.22%  | 0.00%  |
| 过去五年       | 12.99% | 0.05%     | 23.70%     | 0.06%         | -10.71% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 47.80% | 0.08%     | 61.86%     | 0.07%         | -14.06% | 0.01%  |

景顺长城景兴信用纯债债券 F 类

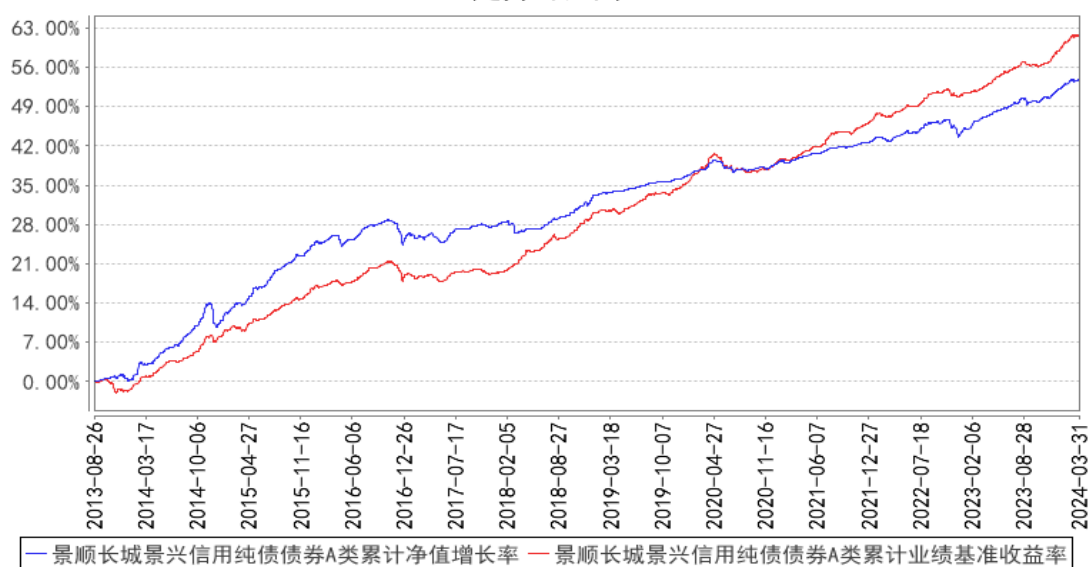
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

|            |       | 准差②   | 收益率③  | 收益率标准差④ |       |       |
|------------|-------|-------|-------|---------|-------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 0.37% | 0.04% | 0.32% | 0.04%   | 0.05% | 0.00% |

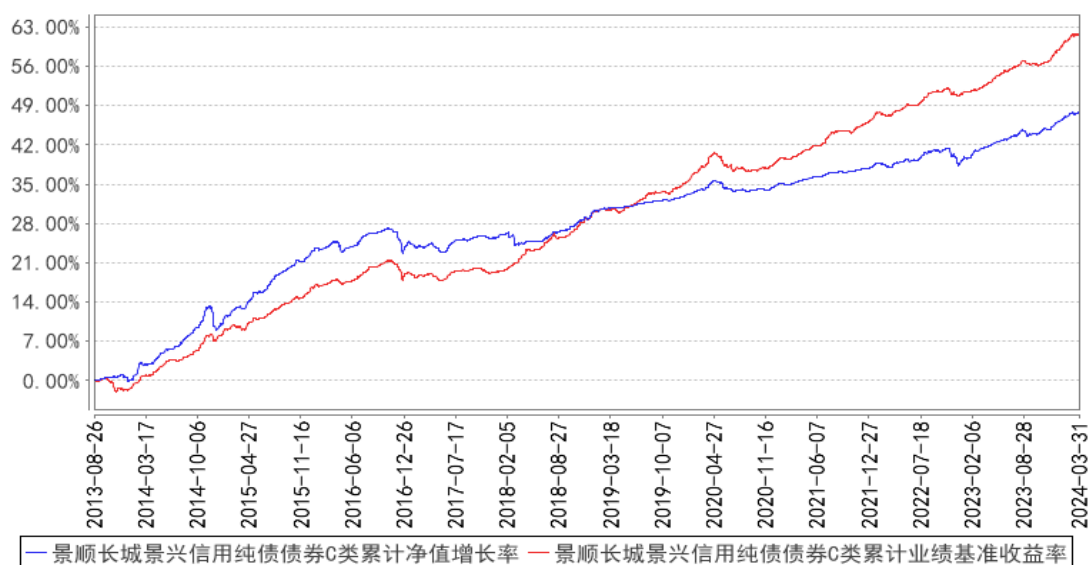
注：本基金自 2024 年 3 月 14 日起增设 F 类基金份额，并于 2024 年 3 月 15 日开始对 F 类基金份额进行估值。

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

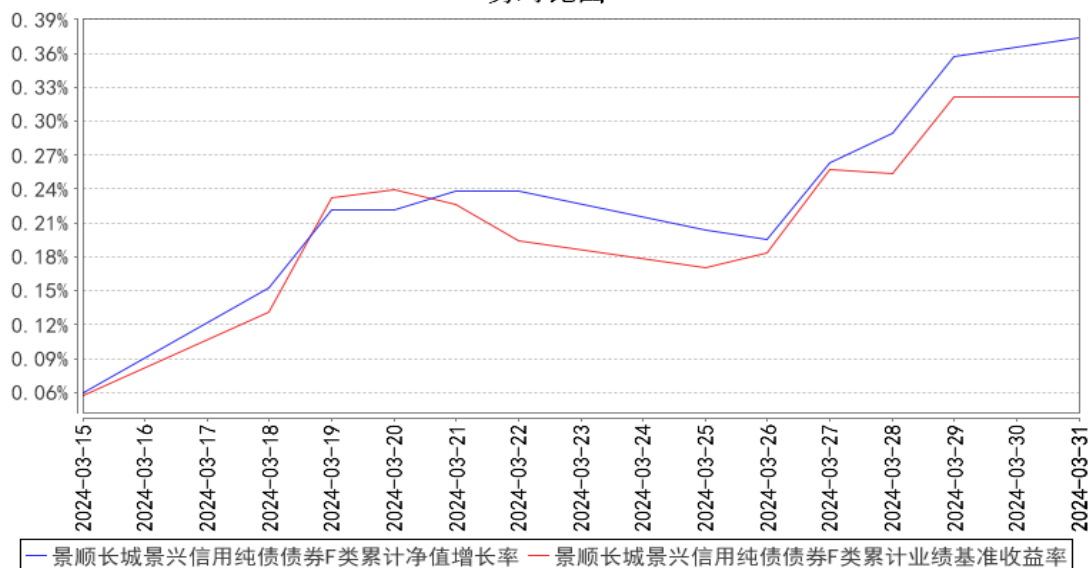
景顺长城景兴信用纯债债券A类累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城景兴信用纯债债券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



景顺长城景兴信用纯债债券F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：本基金资产配置比例为：本基金投资债券资产比例不低于基金资产的 80%，其中对信用债券的投资比例不低于非现金资产的 80%。本基金的建仓期为自 2013 年 8 月 26 日基金合同生效起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。本基金自 2024 年 3 月 14 日起增设 F 类基金份额。

### 3.3 其他指标

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|----------|-------------|------|--------|--|
|     |          | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 何江波 | 本基金的基金经理 | 2019年2月14日  | -    | 14年    | 经济学硕士。曾任中国农业银行股份有限公司总行信用管理部行业政策一处专员。2016年4月加入本公司，担任专户投资部投资经理，自2019年2月起担任固定收益部总监、基金经理。具有14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、《景顺长城景兴信用纯债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 6 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

2024 年 1-2 月经济数据较大幅度超出市场预期，生产端表现尤其强劲。工业增加值同比增长 7%，大幅强于市场预期的 4.3%，季调环比增速也显著偏强，服务业生产指数保持较高增速，同比增长 5.8%。从需求力量来看，出口显著超预期或是生产走强的主要驱动。1-2 月出口以美元计价同比增长 7.1%，大幅强于市场预期的 1.8%，环比增速也显著强于季节性规律，为历史最大值，生产与出口走强行业高度重合，意味着出口带动生产走强。消费延续温和修复，社会消费品零售总额同比增速 5.5%，较去年全年的两年复合增速 3.5% 提升 2 个百分点，服务零售额同比 12.3%，服务消费保持火热，服务消费火热也带动了核心 CPI 走强，2 月核心 CPI 同比上涨 1.2%，为 2022

年 2 月以来最高涨幅。虽然核心 CPI 表现较强，在结构性产能过剩的背景下，总体价格依然面临较大压力，1-2 月总体 PPI 和 CPI 分别为-2.7%和 0%。固定资产投资韧性较强，1-2 月同比增长 4.2%，较去年全年增速 3%提升 1.2 个百分点，主要受制造业投资和基建投资的高增长驱动，房地产对经济的拖累依旧持续，销售端和投资端都没有改善。在我国 GDP 核算以生产法为主的背景下，生产的强劲决定了一季度 GDP 大概率能实现较强开局，预计能实现 5%以上的同比增长。

一季度，银行间资金面整体保持平稳，但资金价格中枢多数情况下仍处于政策利率之上。从央行货币政策执行情况来看，当季央行通过降准和公开市场操作维持流动性相对平稳，出于维稳资本市场以及满足春节取现需求，央行于 2 月 5 日超预期降准 50 个基点，释放流动性约 1 万亿元。同时在 1 月税期、春节前以及月末季末时点上，央行仍通过 7 天、14 天逆回购操作向市场提供流动性支持，确保流动性整体保持平稳。从价格角度来看，央行在一季度并未调整政策利率，DR007 月均值分别为 1.86%、1.86%和 1.89%，资金中枢仍处于政策利率之上。春节后，大行净融出持续高于去年同期，股份制净融出季节性偏弱，但货基和理财净融出的恢复使得资金分层现象明显缓解。另外，央行修改 MPA 考核规则后，银行平滑了月内和月末融出规模，也有助于维持资金面平稳。

NCD 在 1 月上中旬窄幅震荡，央行宣布降准后快速下行，其中 3 个月品种从月内高点 2.4%下行至 2.33%，1 年品种从 2.45%下行至 2.35%，曲线非常平坦。全季来看，大行和农商大量买入存单，尤其是大行买入大超季节性，春节后，随着资金回笼到广义基金，非银在配置压力下加入买入行列，促使 NCD 继续下行，其中 3 个月品种下行幅度更大，期限利差有所修复。但受制于资金中枢维持高位，在此后的时间里，3 个月、1 年期国股行 NCD 基本围绕在 2.15%和 2.25%中枢窄幅波动。

现券市场方面，中短端收益率在当季持续下行，而长端和超长端在前两个月大幅下行后开启震荡行情。虽然一季度出炉的经济和金融数据部分超预期，但市场对于基本面修复的预期仍偏弱，同时 3 月份的两会也并未出台强刺激政策，各地陆续放松的地产政策也并未彻底扭转市场对地产投资的悲观预期，因此整体利多债市。在 1 月份宣布降准、NCD 大幅下行、大行农商行欠配压力、央行行长表示未来仍有降准空间以及资金面相对稳定的情况下，中短端延续年末下行趋势，收益率屡创新低，其中国债 1、3、5 年期品种收益率在一季度分别较去年底下行 36BP、26BP 和 20BP。而长债和超长债在前两个月表现更为突出，受益于政府债发行节奏偏缓、全年对信贷总量诉求有所降低、1 月份权益市场的大幅调整、2 月份 5 年 LPR 超预期下调 25BP 后债券与贷款的比价效应更具有优势等多重利好，10 年、30 年国债活跃券在前两个月分别大幅下行约 20BP、38BP，整体曲线大幅走平。但两会后，因担忧 1 万亿超长期特别国债带来超长债的供给冲击，同时收益率低



点波动加大，30 年国债在 3 月份并未跟随短端继续下行，而是围绕 2.48% 震荡，同时新老券利差大幅走阔，也表明当前市场更多的是交易盘主导，配置力量相对薄弱。

展望二季度，出口的较强表现预计能够持续，全球制造业 PMI 今年 1 月份是 15 个月以来首次回到扩张区间，且连续两个月保持扩张，全球制造业周期的企稳回升叠加美国的补库周期有望带动外需的持续改善。3 月 13 日国务院发布《推动大规模设备更新和消费品以旧换新行动方案》，对设备更新行动提出了更为具体的指导和量化目标，有望继续带动制造业投资保持较高增速。今年一季度地方专项债发行明显偏慢，二季度有望加速发行，叠加超长期国债也有望在二季度落地，基建投资的实物工作量有望明显改善，带动基建投资保持韧性。虽然房地产未见明显起色，322 国常会提出“系统谋划相关支持政策”，后续增量政策的出台或能带动地产投资和销售的边际改善。

债市方面，3 月份 PMI 重回荣枯线之上，宏观经济是否反弹仍需要更多数据验证，但与前期债市对基本面利空钝化相比，在收益率已经大幅下行后，基本面对债市的扰动将逐步放大。前两个月经济数据的超预期表现为全年实现 5% 的目标打下基础，但也意味着强刺激政策出台的可能性有所降低，特别是高能级城市的地产政策也可能按照小步慢跑的节奏出台，从而对债市不构成太大压力。

短期市场交易重心仍在于特别国债的发行方式和发行节奏，若以市场化方式在几个月内集中发行，有助于缓解当前市场普遍存在的“资产荒”问题，但从前期大行、城农商以及保险资金对 NCD 和 1 年内短利率配置情况来看，上述配置盘仍可以承接超长期特别国债的集中供应，长债的调整幅度可控。同时，央行也会配合财政发行，结合行长对于未来降准的表述，发债不会对流动性造成太大冲击，中短端的确定性也更高。在价格方面，考虑到当前较低的银行净息差水平以及 LPR 进一步下行的空间，预计二季度仍存在降低存款利率的可能，而随着联储货币政策转向，也有望打开我国政策利率调降空间，从而制约短端收益率的资金中枢问题有望解决。

二季度对债市整体上维持震荡偏强的判断，中短端仍有进一步下行空间，同时若特别国债发行带来 30 年与 10 年期限利差的修复，也是较好的配置机会。

策略上中短久期债券立足票息，积极把握长久期债券的交易机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2024 年 1 季度，景顺长城景兴信用纯债债券 A 类份额净值增长率为 1.42%，业绩比较基准收益率为 2.09%。

2024 年 1 季度，景顺长城景兴信用纯债债券 C 类份额净值增长率为 1.33%，业绩比较基准收益率为 2.09%。

2024 年 3 月 15 日（F 类基金份额首个估值日）至本报告期末，景顺长城景兴信用纯债债券 F 类份额净值增长率为 0.37%，业绩比较基准收益率为 0.32%。

#### 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              | -                | -            |
|    | 其中：股票             | -                | -            |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 5,001,530,304.66 | 99.99        |
|    | 其中：债券             | 5,001,530,304.66 | 99.99        |
|    | 资产支持证券            | -                | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 460,302.73       | 0.01         |
| 8  | 其他资产              | 166,084.97       | 0.00         |
| 9  | 合计                | 5,002,156,692.36 | 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 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 | 11,949,103.83 | 0.27         |

|    |           |                  |        |
|----|-----------|------------------|--------|
| 2  | 央行票据      | -                | -      |
| 3  | 金融债券      | 2,666,964,661.27 | 61.02  |
|    | 其中：政策性金融债 | 532,697,388.05   | 12.19  |
| 4  | 企业债券      | 278,073,065.37   | 6.36   |
| 5  | 企业短期融资券   | 50,072,693.15    | 1.15   |
| 6  | 中期票据      | 1,994,470,781.04 | 45.63  |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -      |
| 8  | 同业存单      | -                | -      |
| 9  | 其他        | -                | -      |
| 10 | 合计        | 5,001,530,304.66 | 114.43 |

### 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  | 092200008 | 22 农行二级资本债 02A | 1,600,000 | 164,983,973.77 | 3.77         |
| 2  | 2128042   | 21 兴业银行二级 02   | 1,500,000 | 156,004,213.11 | 3.57         |
| 3  | 2228024   | 22 工商银行二级 03   | 1,300,000 | 138,047,710.38 | 3.16         |
| 4  | 230208    | 23 国开 08       | 1,200,000 | 123,849,836.07 | 2.83         |
| 5  | 092280139 | 22 交行二级资本债 02A | 1,200,000 | 123,244,760.66 | 2.82         |

### 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

中国农业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。

兴业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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 5,138.69   |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 160,946.28 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 166,084.97 |

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 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                        | 景顺长城景兴信用<br>纯债债券 A 类 | 景顺长城景兴信<br>用纯债债券 C 类 | 景顺长城景<br>兴信用纯债<br>债券 F 类 |
|---------------------------|----------------------|----------------------|--------------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,589,600,918.86     | 12,077,219.11        | -                        |
| 报告期期间基金总申购份额              | 2,962,845,024.82     | 21,605,179.30        | 80,910.80                |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 873,858,848.20       | 5,893,289.34         | -                        |
| 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               | 3,678,587,095.48     | 27,789,109.07        | 80,910.80                |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本期末未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期末未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 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           | 份额占比(%) |
| 机构    | 1              | 20240101-20240118       | 430,885,039.64 | -    | -    | 430,885,039.64 | 11.63   |

#### 产品特有风险

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：

#### 1、大额申购风险

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。

#### 2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(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；

(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；

(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；

(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；

(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；

(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。

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。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足投资者的理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》等法律法规的规定和《景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，景顺长城基金管理有限公司决定自 2024 年 3 月 14 日起对景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金在现有 A 类、C 类基金份额的基础上增设 F 类基金份额，同时对《基金合同》和《托管协议》进行了相应的修改。详情请参阅本基金管理人于 2024 年 3 月 14 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金增设 F 类基金份额并相应修改基金合同、托管协议部分条款的公告》。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城景兴信用纯债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 4 月 22 日