

景顺长城景颐辰利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 | 景顺长城景颐辰利债券 |
| 基金主代码 | 018214 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 4 月 28 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 159,522,824.34 份 |
| 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，同时适当投资于具备良好盈利能力的上市公司所发行的股票，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>本基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况进行调整，资产配置组合主要以债券等固定收益类资产配置为主，并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例，使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上优化投资组合。</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、股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>4、国债期货投资策略</p> |

| | |
|-----------------|---|
| | <p>本基金可基于谨慎原则，根据风险管理原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>5、基金投资策略</p> <p>本基金可投资经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（仅限于基金管理人旗下的股票型基金及应计入权益类资产的混合型基金、全市场的股票型 ETF，不包含 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、货币市场基金和其他投资范围包含基金的基金）。</p> <p>6、信用衍生品投资策略</p> <p>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> |
| 业绩比较基准 | 中证综合债指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*8%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*2% |
| 风险收益特征 | <p>本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。</p> <p>本基金还可能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> |
| 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 | 景顺长城景颐辰利债券 A 景顺长城景颐辰利债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 018214 018215 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 90,866,172.83 份 68,656,651.51 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） | |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
| | 景顺长城景颐辰利债券 A | 景顺长城景颐辰利债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | -1,714,719.18 | -1,486,801.85 |
| 2. 本期利润 | 1,449,293.02 | 1,226,508.54 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0103 | 0.0111 |
| 4. 期末基金资产净值 | 91,890,515.23 | 69,175,074.34 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0112 | 1.0075 |

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

景顺长城景颐辰利债券 A

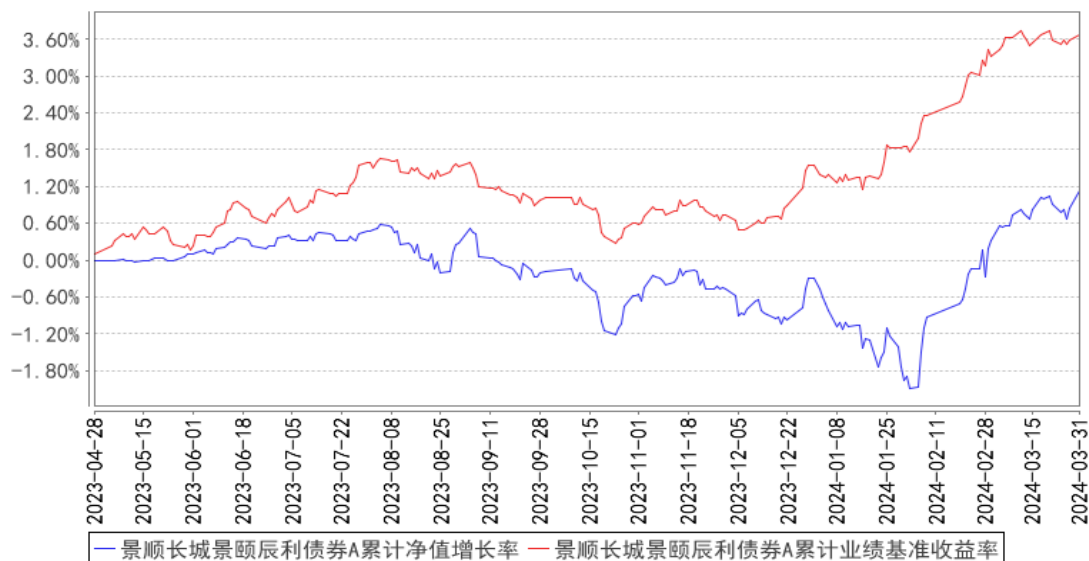
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.42% | 0.21% | 2.11% | 0.11% | -0.69% | 0.10% |
| 过去六个月 | 1.31% | 0.17% | 2.63% | 0.11% | -1.32% | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.12% | 0.14% | 3.68% | 0.10% | -2.56% | 0.04% |

景顺长城景颐辰利债券 C

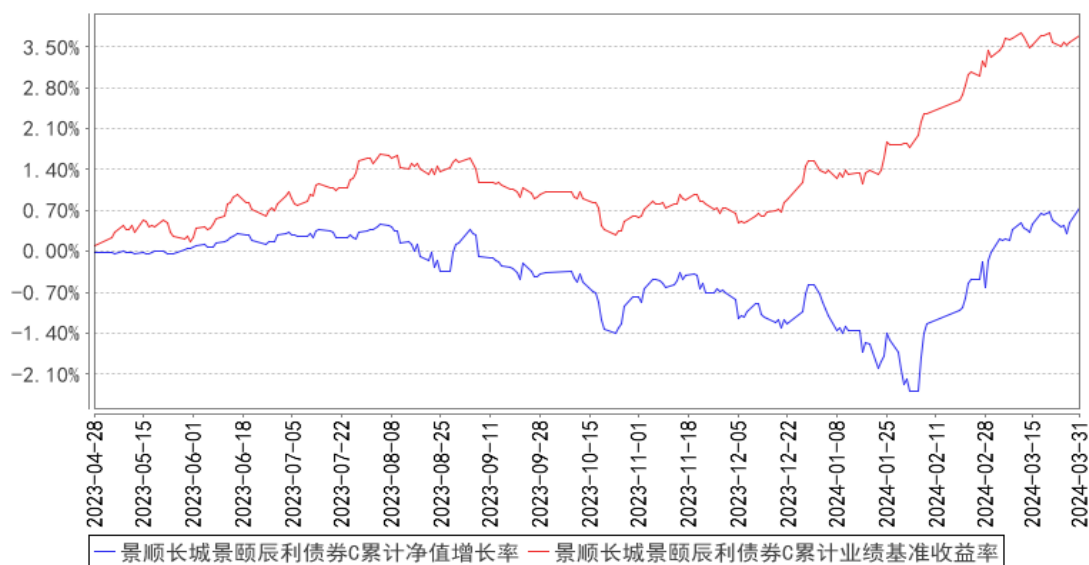
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.32% | 0.21% | 2.11% | 0.11% | -0.79% | 0.10% |
| 过去六个月 | 1.11% | 0.17% | 2.63% | 0.11% | -1.52% | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.75% | 0.14% | 3.68% | 0.10% | -2.93% | 0.04% |

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

景顺长城景颐辰利债券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



景顺长城景颐辰利债券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：本基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于权益类资产、可转换债券（含可分离型可转换债券）及可交换债券比例合计不高于基金资产的 20%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%，本基金投资的权益类资产包括股票、股票型基金以及应计入权益类资产的混合型基金，其中上述应计入权益类资产的混合型基金指根据定期报告披露情况，最近连续四个季度季末股票资产占基金资产的比例均在 60%以上的混合型基金。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金投资比例不超过基金资产净值的 10%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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。本基金的建仓期为自 2023 年 4 月 28 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。报告期末距离建仓结束期未满一年。基金合同生效日（2023 年 4 月 28 日）起至本报告期末不满一年。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈莹 | 本基金的基金经理 | 2023 年 4 月 28 日 | - | 10 年 | 工学硕士。曾任交通银行公司机构部高级行业经理，浙商基金管理有限公司固定收益部信用评级研究员，华安基金管理有限公司固定收益部信用分析师。2019 年 11 月加入本公司，担任固定收益部信用研究员，自 2020 年 7 月起担任固定收益部基金经理，现任混合资产投资部基金经理。具有 10 年证券、基金行业从业经验。 |

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

国内方面，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。海外方面，联储 3 月 FOMC 决议将基准利率维持在 5.25%-5.5% 区间，尽管上调增长通胀预测，但维持 2024 年降息 3 次的指引。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。

一季度权益市场结构分化明显，大盘股表现占优，小盘股下跌明显，一季度，上证指数上涨 2.23%，沪深 300 上涨 3.1%，创业板指下跌 3.87%，中证 2000 下跌 11.05%。因实体融资需求扩张不足，地方债和政金债发行偏慢，债券配置需求较强，债券收益率下行，1Y/3Y/5Y/10Y/30Y 国债

分别下行 36BP/26BP/20BP/26BP/37BP。

一季度组合提升权益仓位至中性水平，以绝对收益为主要思路，结构上以稳健低估值、高股息品种为主，辅以一部分中长期景气度较为确认的估值相对合理的成长品种。组合债券部分立足票息策略，进行结构调整，考虑到极低的信用利差和组合的流动性，减仓流动性较低的信用品种，逢高增配中长久期利率债，维持中性的久期和偏低的杠杆。

展望二季度，经济企稳的支撑因素在增多，全球制造业 PMI 回到扩张区间，全球制造业周期的企稳回升叠加海外补库周期有望带动出口的持续改善。今年一季度地方专项债发行明显偏慢，我们对二季度的发行节奏保持关注，如果发行加快，叠加超长期国债的落地，基建投资的实物工作量有望改善。

债券市场方面，资金面整体宽松，但分层现象较为明显，市场给予的信用债风险溢价较高。长端方面，在当前的基本面预期下，债券市场尚无大的调整风险，但偏低的收益意味着长端可能仍然面临一定的波动。信用债方面，短端具有票息价值，长端利差保护偏弱。在信用资产荒的预期下，信用利差持续压缩，信用利差保护偏弱，更为看好短端信用。在利差压缩到极致过后，城投长期基本面并未发生根本性扭转，不过度追涨弱区域城投。此外，关注二永等品种与城投债相对价值变化，优化组合结构。策略方面，组合整体采用杠杆策略。以短端信用作为底仓，中短端利率债作为套息及交易品种，信用债控制久期，并在相对价值的变化中调整仓位。

权益市场方面，当前 A 股估值水平依然在底部区间，股债性价比较高，维持对于未来市场谨慎乐观看法，一方面，持有高股息低波资产，另一方面，在成长和消费方面也积极关注逢低增配潜在机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2024 年 1 季度，景顺长城景颐辰利债券 A 份额净值增长率为 1.42%，业绩比较基准收益率为 2.11%。

2024 年 1 季度，景顺长城景颐辰利债券 C 份额净值增长率为 1.32%，业绩比较基准收益率为 2.11%。

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 | 24,814,766.65 | 12.15 |
| | 其中：股票 | 24,814,766.65 | 12.15 |
| 2 | 基金投资 | 815,717.50 | 0.40 |
| 3 | 固定收益投资 | 170,266,805.70 | 83.36 |
| | 其中：债券 | 170,266,805.70 | 83.36 |
| | 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 | 352,905.32 | 0.17 |
| 8 | 其他资产 | 7,993,475.08 | 3.91 |
| 9 | 合计 | 204,243,670.25 | 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 1,122,127.59 元，占基金资产净值的比例为 0.70%。

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 | 7,596,363.00 | 4.72 |
| C | 制造业 | 14,347,763.06 | 8.91 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 402,867.00 | 0.25 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 617,546.00 | 0.38 |
| J | 金融业 | 565,460.00 | 0.35 |
| 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 | 162,640.00 | 0.10 |

| | | | |
|---|----|---------------|-------|
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 23,692,639.06 | 14.71 |

5.2.2 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 | - | - |
| 周期性消费品 | - | - |
| 非周期性消费品 | - | - |
| 综合 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 基金 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 信息技术 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 通讯 | 1,122,127.59 | 0.70 |
| 合计 | 1,122,127.59 | 0.70 |

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

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 | 601899 | 紫金矿业 | 122,600 | 2,062,132.00 | 1.28 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 1,100 | 1,873,190.00 | 1.16 |
| 3 | 00700 | 腾讯控股 | 4,000 | 1,101,639.56 | 0.68 |
| 4 | 600938 | 中国海油 | 30,000 | 876,900.00 | 0.54 |
| 5 | 601666 | 平煤股份 | 69,200 | 849,084.00 | 0.53 |
| 6 | 601898 | 中煤能源 | 73,400 | 839,696.00 | 0.52 |
| 7 | 601857 | 中国石油 | 83,000 | 820,040.00 | 0.51 |
| 8 | 600690 | 海尔智家 | 29,800 | 743,510.00 | 0.46 |
| 9 | 600489 | 中金黄金 | 54,300 | 717,303.00 | 0.45 |
| 10 | 300750 | 宁德时代 | 3,300 | 627,528.00 | 0.39 |

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 | 82,676,567.21 | 51.33 |
| | 其中：政策性金融债 | 20,726,262.30 | 12.87 |
| 4 | 企业债券 | 71,476,426.85 | 44.38 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|----------------|--------|
| 6 | 中期票据 | 15,572,553.00 | 9.67 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 541,258.64 | 0.34 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 170,266,805.70 | 105.71 |

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 | 220215 | 22 国开 15 | 100,000 | 10,560,655.74 | 6.56 |
| 2 | 2028024 | 20 中信银行二级 | 100,000 | 10,439,403.28 | 6.48 |
| 3 | 102100869 | 21 溧水城建 MTN001 | 100,000 | 10,437,205.46 | 6.48 |
| 4 | 1920049 | 19 成都银行二级 | 100,000 | 10,360,781.42 | 6.43 |
| 5 | 2228003 | 22 兴业银行二级 01 | 100,000 | 10,312,819.67 | 6.40 |

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

本基金可基于谨慎原则，根据风险管理原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

5.9.2 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

中信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。

平顶山天安煤业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到环保部的处罚。

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 | 4,697.62 |
| 2 | 应收证券清算款 | 7,981,522.59 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 7,254.87 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 7,993,475.08 |

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 | 504,656.68 | 0.31 |
| 2 | 113042 | 上银转债 | 36,601.96 | 0.02 |

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 基金中基金

6.1 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基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|--------------------------------|-------------|------------|------------|--------------|------------------------|
| 1 | 515100 | 景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金 | 交易型开放式(ETF) | 617,500.00 | 815,717.50 | 0.51 | 是 |

6.1.1 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公开募集基础设施证券投资基金投资明细

本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日 | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|----------------------|--------------------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费(元) | 32.37 | 32.37 |
| 当期交易基金产生的赎回费(元) | - | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费(元) | - | - |
| 当期持有基金产生的应支付管理费(元) | 33.31 | 33.31 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费(元) | 6.67 | 6.67 |

注：1、上述交易基金产生的申购费包含场外基金申购/转入费用及场内基金买入交易费用，交易基金产生的赎回费包含场外基金赎回/转出费用及场内基金卖出交易费用；

2、上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；销售服务费、管理费和托管费已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目；

3、本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金(ETF 除外)，应当通过基金管理人

的直销渠道且不得收取申购费、赎回费(按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外)、销售服务费等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免,故当期交易基金产生的申购费为零,当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值,由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还,当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费,相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值,相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§ 7 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 景顺长城景颐辰利债券 A | 景顺长城景颐辰利债券 C |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 172,932,355.27 | 128,712,284.15 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 80,785.62 | 566,219.52 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 82,146,968.06 | 60,621,852.16 |
| 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 | 90,866,172.83 | 68,656,651.51 |

注:申购含红利再投、转换入份额;赎回含转换出份额。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 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。

8.2 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。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城景颐辰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。

10.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

10.3 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