

# 景顺长城顺益回报混合型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告

2025 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 10 月 28 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 10 月 27 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 2025 年 7 月 1 日起至 2025 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 景顺长城顺益回报混合                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 场内简称       | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 基金主代码      | 002792                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 基金合同生效日    | 2016 年 12 月 7 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 报告期末基金份额总额 | 17,766,261.09 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       | 1、资产配置策略<br>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、权益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。<br>2、固定收益类资产投资策略<br>（1）债券类属资产配置<br>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 |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                 |  |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--|
|                 | <p>利差变化所带来的投资收益。</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> <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）中小企业私募债券投资策略</p> <p>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> <p>3、权益资产投资策略</p> <p>（1）股票投资策略</p> <p>本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略，本基金将从定性及定量两个方面加以考察分析投资标的。</p> <p>（2）权证投资策略</p> <p>本基金不直接购买权证等衍生品资产，但有可能持有所持股票所派发的权证或因投资分离交易可转债而产生的权证等。本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，结合权证的溢价率、隐含波动率等指标选择权证的卖出时机。</p> |                 |  |
| 业绩比较基准          | 85%×中证综合债指数收益率 + 15% ×沪深 300 指数收益率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                 |  |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，属于中等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           | 交通银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                 |  |
| 下属分级基金的基金简称     | 景顺长城顺益回报混合 A 类                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 景顺长城顺益回报混合 C 类  |  |
| 下属分级基金的交易代码     | 002792                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 002793          |  |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 6,218,551.94 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 11,547,709.15 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（2025 年 7 月 1 日-2025 年 9 月 30 日） |
|--------|-------------------------------------|

|                 | 景顺长城顺益回报混合 A 类 | 景顺长城顺益回报混合 C 类 |
|-----------------|----------------|----------------|
| 1. 本期已实现收益      | 411,233.94     | 647,360.68     |
| 2. 本期利润         | 409,358.46     | 573,670.40     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0577         | 0.0476         |
| 4. 期末基金资产净值     | 9,965,115.33   | 17,836,384.65  |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.6024         | 1.5445         |

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

景顺长城顺益回报混合 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④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 3.65%  | 0.19%     | 1.74%      | 0.12%         | 1.91%  | 0.07%  |
| 过去六个月      | 5.70%  | 0.18%     | 3.50%      | 0.12%         | 2.20%  | 0.06%  |
| 过去一年       | 7.39%  | 0.16%     | 4.92%      | 0.17%         | 2.47%  | -0.01% |
| 过去三年       | 10.03% | 0.21%     | 15.16%     | 0.16%         | -5.13% | 0.05%  |
| 过去五年       | 20.66% | 0.21%     | 22.05%     | 0.17%         | -1.39% | 0.04%  |
| 自基金合同生效起至今 | 60.24% | 0.25%     | 44.25%     | 0.17%         | 15.99% | 0.08%  |

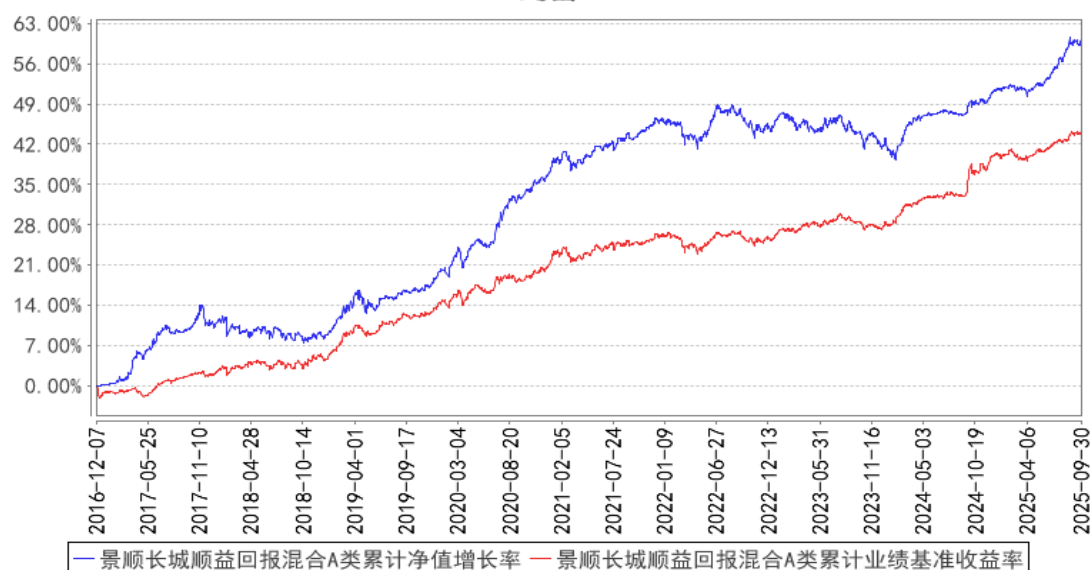
景顺长城顺益回报混合 C 类

| 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 | 3.55%  | 0.19%     | 1.74%      | 0.12%         | 1.81% | 0.07%  |
| 过去六个月 | 5.49%  | 0.18%     | 3.50%      | 0.12%         | 1.99% | 0.06%  |
| 过去一年  | 6.95%  | 0.16%     | 4.92%      | 0.17%         | 2.03% | -0.01% |

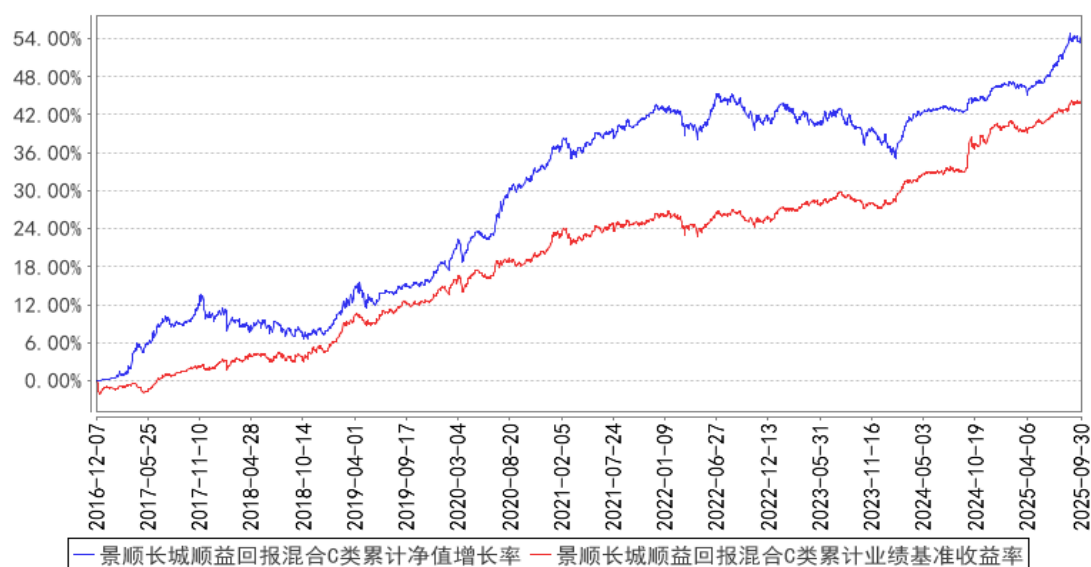
|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三年       | 8.66%  | 0.21% | 15.16% | 0.16% | -6.50% | 0.05% |
| 过去五年       | 18.22% | 0.21% | 22.05% | 0.17% | -3.83% | 0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 54.45% | 0.25% | 44.25% | 0.17% | 10.20% | 0.08% |

### 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

景顺长城顺益回报混合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



景顺长城顺益回报混合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：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 70%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，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 2016 年 12 月 7 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 |        |                                                                                                                                                             |
| 陈莹  | 本基金的基金经理 | 2020 年 7 月 25 日 | -    | 11 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 11 年证券、基金行业从业经验。 |
| 李训练 | 本基金的基金经理 | 2025 年 5 月 22 日 | -    | 8 年    | 管理学硕士，FRM。曾任长城基金固定收益部研究员、固定收益投资部投资经理。2022 年 9 月加入本公司，自 2023 年 3 月起开始担任混合资产投资部基金经理。具有 8 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、《景顺长城顺益回报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 7 次，为公司旗下的指数量化投资组合与其他组合因投资策略需要而发生的同日反向交易，或为公司管理的投资组合与公司担任投资顾问的 MOM 组合因投资策略不同而发生的同日反向交易。

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

进入三季度以来，经济压力开始显现，内外需共振回落走弱，但在反内卷推动下，价格水平有所好转。在实体经济走弱的背景下，融资需求萎靡，信贷增速走低。房地产销售跌幅进一步走扩，818 国务院全体会议提出“采取有力措施巩固房地产市场止跌回稳态势”，北京、上海、深圳接连放松非核心区限购以及调整信贷政策，但整体效果有限，房地产市场的新一轮下滑对居民消费和预期形成冲击。固定资产投资大幅放缓，制造业和基建投资增速走弱，房地产投资延续下滑趋势。在反内卷的推动下，预计价格水平有所改善，但是向上的弹性取决于后续反内卷推进力度以及是否有需求侧政策的配合。

海外方面，9 月 FOMC 会议如期降息 25BP 至 4.00%-4.25%，鲍威尔把本次降息定义为风险管理式降息，应对劳动力市场的快速降温，认为新一轮降息对经济增长的下行压力有着非常好的对冲作用，同时带来通胀温和提升。

市场表现上，三季度债券收益率上行，股票上涨，市场风险偏好明显改善。股票大幅上涨，但市场结构分化较大，科技领涨，AI、机器人、锂电等板块均有较好表现。美联储降息背景下，黄金表现强势。而代表经济复苏方向的消费和地产链和国内定价的资源板块表现较差。风险偏好改善背景下，利率出现明显上行，以银行股为代表的红利资产表现落后。

操作方面，本基金对长久期利率债进行了波段操作，转债方面以自下而上操作为主。股票方面，对股票市场中长期较为乐观，主要选取价值型公司，综合考虑企业竞争优势、公司估值以及行业景气度等维度。

展望未来，经济动能回升仍需财政和货币政策持续加力提振内需。我们对债券市场整体看法中性，收益率逢高配置中短端债券；转债部分更关注自下而上择券；股票部分，对股票市场中长期前景保持积极看法，积极跟踪各行业和公司的经营变化，长期配置竞争力强、有业绩支撑、估值合理的优质公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 3.65%，业绩比较基准收益率为 1.74%。  
本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 3.55%，业绩比较基准收益率为 1.74%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2024 年 10 月 8 日至 2025 年 9 月 30 日，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。本基金管理人已按照基金合同要求向中国证监会报告解决方案。  
同时为减轻迷你基金固定费用支出给投资者造成的负担，切实保障基金份额持有人利益，自 2024 年 12 月 31 日起至本报告期末，我司承担本基金的固定费用（包括信息披露费、审计费等）。

§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              | 4,764,476.35  | 14.17        |
|    | 其中：股票             | 4,764,476.35  | 14.17        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 26,453,351.50 | 78.67        |
|    | 其中：债券             | 26,453,351.50 | 78.67        |
|    | 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      | 1,909,411.58  | 5.68         |
| 8  | 其他资产              | 499,281.97    | 1.48         |
| 9  | 合计                | 33,626,521.40 | 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              | 367,480.00   | 1.32         |
| C  | 制造业              | 2,947,922.35 | 10.60        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 157,253.00   | 0.57         |
| E  | 建筑业              | —            | —            |
| F  | 批发和零售业           | —            | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 212,625.00   | 0.76         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —            | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 37,278.00    | 0.13         |
| J  | 金融业              | 1,012,668.00 | 3.64         |
| K  | 房地产业             | 29,250.00    | 0.11         |
| 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               | 4,764,476.35 | 17.14        |

## 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  | 600519 | 贵州茅台 | 300    | 433,197.00 | 1.56         |
| 2  | 600690 | 海尔智家 | 12,900 | 326,757.00 | 1.18         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 6,700  | 270,747.00 | 0.97         |
| 4  | 000001 | 平安银行 | 23,500 | 266,490.00 | 0.96         |
| 5  | 600926 | 杭州银行 | 17,300 | 264,171.00 | 0.95         |
| 6  | 000568 | 泸州老窖 | 1,300  | 171,496.00 | 0.62         |
| 7  | 601688 | 华泰证券 | 7,800  | 169,806.00 | 0.61         |
| 8  | 301219 | 腾远钴业 | 2,200  | 167,464.00 | 0.60         |
| 9  | 601168 | 西部矿业 | 7,500  | 165,000.00 | 0.59         |

|    |        |      |       |            |      |
|----|--------|------|-------|------------|------|
| 10 | 002831 | 裕同科技 | 5,600 | 153,384.00 | 0.55 |
|----|--------|------|-------|------------|------|

#### 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      | 17,434,005.83 | 62.71        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 4,190,909.04  | 15.07        |
|    | 其中：政策性金融债 | 4,190,909.04  | 15.07        |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 4,828,436.63  | 17.37        |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 26,453,351.50 | 95.15        |

#### 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  | 019774 | 25 注特 01 | 81,000 | 8,092,843.15 | 29.11        |
| 2  | 019786 | 25 国债 14 | 51,000 | 5,104,017.12 | 18.36        |
| 3  | 019742 | 24 特国 01 | 31,860 | 3,432,070.93 | 12.34        |
| 4  | 210210 | 21 国开 10 | 20,000 | 2,182,874.52 | 7.85         |
| 5  | 250421 | 25 农发 21 | 20,000 | 2,008,034.52 | 7.22         |

#### 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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

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

国家开发银行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监管局、中国人民银行等处罚。

中国农业发展银行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。

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方交通运输局、国家金融监督管理总局等处罚。

平安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监管局的处罚。

杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局地方分局的处罚。

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未出现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   | 6,603.44   |
| 2  | 应收证券清算款 | 491,119.30 |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | —          |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 1, 559. 23   |
| 6 | 其他应收款 | —            |
| 7 | 其他    | —            |
| 8 | 合计    | 499, 281. 97 |

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  | 123151 | 康医转债    | 717, 020. 72 | 2. 58        |
| 2  | 127056 | 中特转债    | 591, 549. 63 | 2. 13        |
| 3  | 118022 | 锂科转债    | 443, 815. 40 | 1. 60        |
| 4  | 127016 | 鲁泰转债    | 348, 159. 87 | 1. 25        |
| 5  | 123117 | 健帆转债    | 336, 290. 88 | 1. 21        |
| 6  | 123109 | 昌红转债    | 317, 987. 12 | 1. 14        |
| 7  | 123192 | 科思转债    | 304, 933. 34 | 1. 10        |
| 8  | 118032 | 建龙转债    | 293, 106. 67 | 1. 05        |
| 9  | 123104 | 卫宁转债    | 245, 550. 84 | 0. 88        |
| 10 | 113067 | 燃 23 转债 | 239, 717. 51 | 0. 86        |
| 11 | 123150 | 九强转债    | 237, 435. 73 | 0. 85        |
| 12 | 113679 | 芯能转债    | 232, 782. 32 | 0. 84        |
| 13 | 123122 | 富瀚转债    | 152, 178. 36 | 0. 55        |
| 14 | 127027 | 能化转债    | 145, 456. 76 | 0. 52        |
| 15 | 127088 | 赫达转债    | 61, 858. 63  | 0. 22        |
| 16 | 128121 | 宏川转债    | 11, 551. 32  | 0. 04        |

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                        | 景顺长城顺益回报混合 A 类  | 景顺长城顺益回报混合 C 类   |
|---------------------------|-----------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 7, 302, 664. 89 | 10, 339, 921. 33 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 845, 330. 44    | 6, 947, 384. 55  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 1, 929, 443. 39 | 5, 739, 596. 73  |
| 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               | 6, 218, 551. 94 | 11, 547, 709. 15 |

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

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》和《景顺长城顺益回报混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司经与本基金的基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，决定以通讯开会方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议关于持续运作景顺长城顺益回报混合型证券投资基金的议案。根据投票统计结果，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额未达到权益登记日本基金总份额的 50%，因此未达到法定的会议召开条件。详情请参阅本基金管理人发布的一系列相关公告。

## §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顺益回报混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城顺益回报混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城顺益回报混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城顺益回报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

2025 年 10 月 28 日