

# 景顺长城景颐双利债券型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 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：北京银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 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 2023 年 10 月 24 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 2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 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 | 12,718,189,753.22 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。<br>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 | 11,908,785,979.88 份  | 809,403,773.34 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（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 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      | 129,173,358.43                      | 7,261,501.07     |
| 2. 本期利润         | 139,594,748.44                      | 8,290,768.87     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0110                              | 0.0095           |
| 4. 期末基金资产净值     | 18,892,852,345.26                   | 1,234,699,338.25 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.586                               | 1.525            |

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

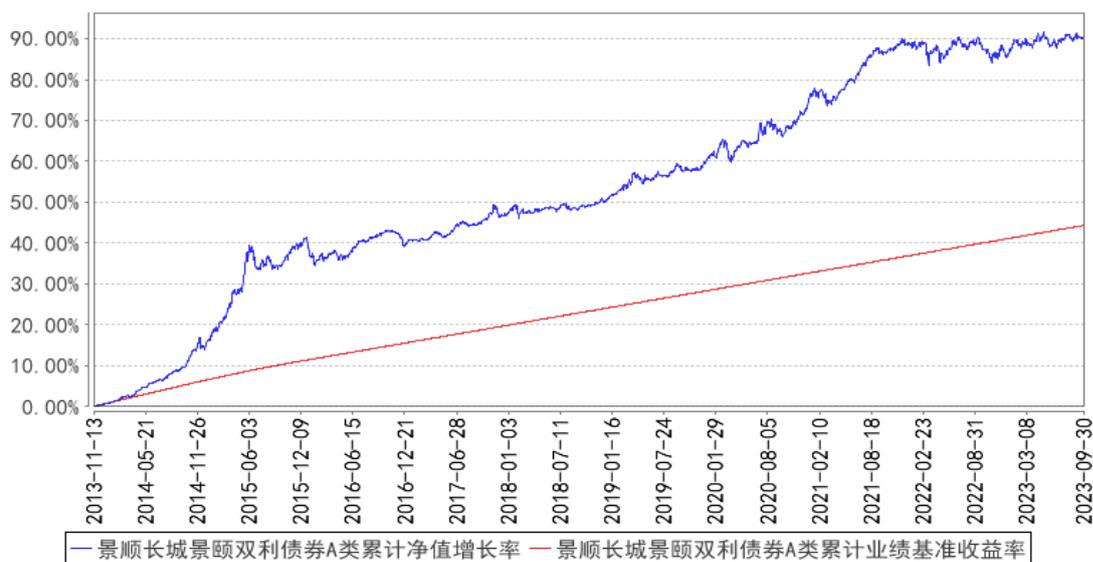
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.63%  | 0.16%     | 0.75%      | 0.01%         | -0.12% | 0.15% |
| 过去六个月      | 0.83%  | 0.19%     | 1.50%      | 0.01%         | -0.67% | 0.18% |
| 过去一年       | 1.47%  | 0.22%     | 3.03%      | 0.01%         | -1.56% | 0.21% |
| 过去三年       | 14.29% | 0.24%     | 9.69%      | 0.01%         | 4.60%  | 0.23% |
| 过去五年       | 27.36% | 0.24%     | 17.27%     | 0.01%         | 10.09% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 90.28% | 0.24%     | 44.30%     | 0.01%         | 45.98% | 0.23% |

景顺长城景颐双利债券 C 类

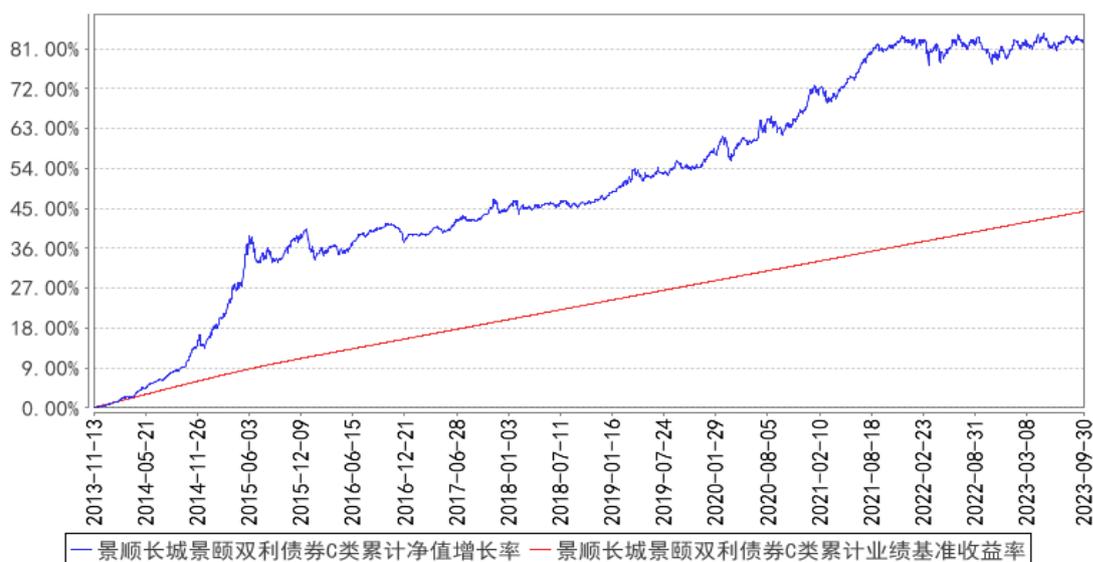
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.53%  | 0.16%     | 0.75%      | 0.01%         | -0.22% | 0.15% |
| 过去六个月      | 0.66%  | 0.19%     | 1.50%      | 0.01%         | -0.84% | 0.18% |
| 过去一年       | 1.06%  | 0.22%     | 3.03%      | 0.01%         | -1.97% | 0.21% |
| 过去三年       | 12.90% | 0.24%     | 9.69%      | 0.01%         | 3.21%  | 0.23% |
| 过去五年       | 24.86% | 0.24%     | 17.27%     | 0.01%         | 7.59%  | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 82.92% | 0.24%     | 44.30%     | 0.01%         | 38.62% | 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 | -    | 17 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 17 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  | -    | 17 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 17 年证券、基金行业从业经验。 |
| 郭杰  | 本基金的基金经理助理 | 2021 年 12 月 17 日 | -    | 8 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 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 5 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

三季度国内经济企稳回升，海外经济保持韧性。国内经济在二季度超预期回落后，7 月底政治局会议积极表态，稳定市场信心。随后，以地产为代表的一系列政策陆续出台，包括首付比例下调、限购限售的进一步放松、一线城市“认房不认贷”和调降存量房贷利率等措施。8 月以来国内经济温和修复。具体看来，房地产销售和投资底部企稳再叠加去年低基数原因，同比降幅收窄；国内制造业 PMI 环比持续改善，从 6 月的 49% 上行至 9 月的 50.2%，重回扩张区间；社会消费品零售总额同比增速从 6 月 3.1% 震荡回升至 8 月 4.6%；CPI 也转正回暖。此外，货币政策保持稳健，精准发力。三季度央行加大了逆周期调节力度，在 8 月进行了非对称降息后，于 9 月实施了年内的第二次降准，社融增速触底回升。市场表现方面，上证指数在三季度震荡下跌 2.86%，并于 9 月有所企稳。10 年国债收益率先下后上，整体小幅上行 4BP。海外方面，美国经济总体保持韧性。美国今年以来消费维持强劲，实际 GDP 增长和非农就业不断超出预期。美联储采取“边走边看”的决策模式，美股震荡下行，美债收益率创本轮调整新高。操作方面，本季度债券配置仍以高等级短久期品种为主，逢高加仓了部分 1~3 年银行次级债，并减持了长久期利率债，久期总体保持中性偏低水平。股票方面，三季度市场总体震荡偏弱，顺周期尤其上游能源板块表现较好。

展望四季度，我们认为国内经济保持温和修复态势，对债市持中性的判断，相对看好股市行

情。具体看来，政策组合拳的发力叠加金九银十旺季有望带动地产需求筑底并有所改善；大规模专项债发行和配套贷款发放支撑基建需求；价格筑底反弹后，企业盈利、投资等有望持续转暖，进而提振居民收入，带动消费的继续改善。此外，我们密切关注政策出台的效果和持续性，预计在此期间货币政策保持稳健。操作方面，债券组合会根据市场情况灵活操作，保持组合的流动性。股票方面总体看法维持不变，市场处于底部区域，预计在经过近 3 个季度下滑后市场对于经济悲观定价已经反映较为充分，随着盈利逐步企稳及库存周期触底，政策宽松周期来临及相对较高的股债性价比，对于四季度股市持相对积极看法，而海外随着高利率的滞后效应在逐步显现，我们预计接下来美国经济明显回落可能性大，前期强美元、高美债利率对国内的资本市场的压制会得到明显缓解，人民币资产吸引力将会逐步回升。我们将保持股票行业结构的相对均衡配置，除了新能源、高端装备、新材料、人工智能、军工在内的一些长期高质量发展的方向外，也会重点配置受益于国内经济复苏带来的盈利弹性品种。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2023 年 3 季度，景顺长城景颐双利债券 A 类份额净值增长率为 0.63%，业绩比较基准收益率为 0.75%。

2023 年 3 季度，景顺长城景颐双利债券 C 类份额净值增长率为 0.53%，业绩比较基准收益率为 0.75%。

#### 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              | 3,450,920,028.34  | 15.20        |
|    | 其中：股票             | 3,450,920,028.34  | 15.20        |
| 2  | 基金投资              | -                 | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 18,877,490,009.22 | 83.13        |
|    | 其中：债券             | 18,877,490,009.22 | 83.13        |
|    | 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          | 115,012,448.77    | 0.51         |
|    | 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 | 70,995,622.03     | 0.31   |
| 8 | 其他资产         | 193,858,026.33    | 0.85   |
| 9 | 合计           | 22,708,276,134.69 | 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         | 128,621,385.20   | 0.64         |
| B  | 采矿业              | 937,225,183.20   | 4.66         |
| C  | 制造业              | 1,648,277,446.10 | 8.19         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                | -            |
| E  | 建筑业              | 40,433,052.00    | 0.20         |
| F  | 批发和零售业           | -                | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 315,746,159.28   | 1.57         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -                | -            |
| J  | 金融业              | 106,041,291.90   | 0.53         |
| K  | 房地产业             | 124,926,989.00   | 0.62         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -                | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 52,694,502.46    | 0.26         |
| 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          | 96,954,019.20    | 0.48         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -                | -            |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 3,450,920,028.34 | 17.15        |

### 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 | 15,081,512 | 278,404,711.52 | 1.38         |
| 2  | 600938 | 中国海油 | 9,201,213  | 194,513,642.82 | 0.97         |
| 3  | 688012 | 中微公司 | 912,181    | 137,328,849.55 | 0.68         |
| 4  | 600489 | 中金黄金 | 12,437,723 | 136,068,689.62 | 0.68         |

|    |        |      |            |                |      |
|----|--------|------|------------|----------------|------|
| 5  | 300498 | 温氏股份 | 7,400,540  | 128,621,385.20 | 0.64 |
| 6  | 601111 | 中国国航 | 15,763,388 | 127,368,175.04 | 0.63 |
| 7  | 601857 | 中国石油 | 14,448,834 | 115,301,695.32 | 0.57 |
| 8  | 688120 | 华海清科 | 581,977    | 110,866,005.50 | 0.55 |
| 9  | 300750 | 宁德时代 | 535,860    | 108,795,655.80 | 0.54 |
| 10 | 688072 | 拓荆科技 | 421,988    | 100,521,761.48 | 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      | 370,009,175.57    | 1.84         |
| 2  | 央行票据      | -                 | -            |
| 3  | 金融债券      | 9,442,744,418.01  | 46.91        |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,149,928,839.02  | 5.71         |
| 4  | 企业债券      | 2,893,793,700.25  | 14.38        |
| 5  | 企业短期融资券   | 10,106,714.75     | 0.05         |
| 6  | 中期票据      | 2,736,678,418.99  | 13.60        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 3,424,157,581.65  | 17.01        |
| 8  | 同业存单      | -                 | -            |
| 9  | 其他        | -                 | -            |
| 10 | 合计        | 18,877,490,009.22 | 93.79        |

#### 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  | 113044  | 大秦转债           | 9,844,270  | 1,159,042,773.33 | 5.76         |
| 2  | 113052  | 兴业转债           | 10,448,420 | 1,078,211,390.93 | 5.36         |
| 3  | 1920059 | 19江苏银行二级       | 8,700,000  | 882,584,954.10   | 4.38         |
| 4  | 1928006 | 19工商银行二级<br>01 | 6,400,000  | 658,938,754.10   | 3.27         |
| 5  | 1928004 | 19农业银行二级<br>02 | 5,800,000  | 597,594,981.42   | 2.97         |

#### 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

江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行及国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚。

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分支机构的处罚。

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   | 4,097,496.59   |
| 2  | 应收证券清算款 | 188,144,712.76 |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | -              |
| 5  | 应收申购款   | 1,615,691.98   |
| 6  | 其他应收款   | 125.00         |
| 7  | 其他      | -              |
| 8  | 合计      | 193,858,026.33 |

## 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  | 113044 | 大秦转债    | 1,159,042,773.33 | 5.76         |
| 2  | 113052 | 兴业转债    | 1,078,211,390.93 | 5.36         |
| 3  | 110073 | 国投转债    | 282,440,198.11   | 1.40         |
| 4  | 113066 | 平煤转债    | 83,836,447.35    | 0.42         |
| 5  | 127056 | 中特转债    | 71,609,053.74    | 0.36         |
| 6  | 113056 | 重银转债    | 67,938,398.85    | 0.34         |
| 7  | 110088 | 淮 22 转债 | 67,464,438.85    | 0.34         |
| 8  | 127018 | 本钢转债    | 58,134,367.14    | 0.29         |
| 9  | 113633 | 科沃转债    | 56,735,458.64    | 0.28         |
| 10 | 113021 | 中信转债    | 52,059,332.02    | 0.26         |
| 11 | 128135 | 洽洽转债    | 51,769,929.41    | 0.26         |
| 12 | 110081 | 闻泰转债    | 41,891,398.83    | 0.21         |
| 13 | 113043 | 财通转债    | 41,789,382.74    | 0.21         |
| 14 | 128048 | 张行转债    | 35,241,344.56    | 0.18         |
| 15 | 113629 | 泉峰转债    | 35,078,750.68    | 0.17         |
| 16 | 110053 | 苏银转债    | 33,718,443.41    | 0.17         |
| 17 | 127039 | 北港转债    | 23,506,012.84    | 0.12         |
| 18 | 110079 | 杭银转债    | 17,145,150.98    | 0.09         |
| 19 | 113065 | 齐鲁转债    | 12,868,081.08    | 0.06         |
| 20 | 113050 | 南银转债    | 12,163,031.13    | 0.06         |
| 21 | 110047 | 山鹰转债    | 10,927,871.98    | 0.05         |
| 22 | 110089 | 兴发转债    | 9,971,429.78     | 0.05         |
| 23 | 113049 | 长汽转债    | 8,840,749.12     | 0.04         |
| 24 | 113623 | 凤 21 转债 | 8,071,857.68     | 0.04         |
| 25 | 110063 | 鹰 19 转债 | 6,267,884.00     | 0.03         |
| 26 | 113024 | 核建转债    | 5,212,165.94     | 0.03         |
| 27 | 128136 | 立讯转债    | 5,157,377.22     | 0.03         |
| 28 | 110087 | 天业转债    | 5,039,285.50     | 0.03         |
| 29 | 123107 | 温氏转债    | 4,363,603.37     | 0.02         |
| 30 | 110043 | 无锡转债    | 2,730,004.40     | 0.01         |
| 31 | 127025 | 冀东转债    | 2,132,172.60     | 0.01         |
| 32 | 128097 | 奥佳转债    | 1,754,266.45     | 0.01         |
| 33 | 113047 | 旗滨转债    | 1,693,973.94     | 0.01         |
| 34 | 113641 | 华友转债    | 1,672,080.36     | 0.01         |
| 35 | 123108 | 乐普转 2   | 850,826.31       | 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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|------|------|----------------|--------------|----------|
|----|------|------|----------------|--------------|----------|

|   |        |      |               |      |              |
|---|--------|------|---------------|------|--------------|
| 1 | 688120 | 华海清科 | 13,684,160.00 | 0.07 | 询价转让流<br>通受限 |
|---|--------|------|---------------|------|--------------|

#### 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               | 13,385,388,291.97 | 919,217,482.93 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,048,094,608.15  | 100,377,170.76 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 2,524,696,920.24  | 210,190,880.35 |
| 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               | 11,908,785,979.88 | 809,403,773.34 |

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

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

2023 年 10 月 25 日