

景顺长城景盈双利债券型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2025 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

7.6 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	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 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贵金属投资明细	48
7.9 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	48
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.11 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
11.1 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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城景盈双利债券型证券投资基金	
基金简称	景顺长城景盈双利债券	
场内简称	无	
基金主代码	002796	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 19 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	
报告期末基金份额总额	2,422,315,077.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城景盈双利债券 A 类	景顺长城景盈双利债券 C 类
下属分级基金的交易代码	002796	002797
报告期末下属分级基金的份额总额	2,099,321,004.17 份	322,994,073.69 份

2.2 基金产品说明

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	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。 2、固定收益类资产投资策略： （1）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。 （2）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。 （3）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，基金管

	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。 (4) 中小企业私募债券投资策略：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。
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×10%
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	王小飞
	联系电话	0755-82370388	021-60637103
	电子邮箱	investor@igwfm.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4008888606	021-60637228
传真		0755-22381339	021-60635778
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		叶才	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
------------	-------------------------------------

和指标	景顺长城景盈双利债券 A 类	景顺长城景盈双利债券 C 类
本期已实现收益	27,949,755.08	2,197,624.94
本期利润	52,430,549.71	3,844,187.15
加权平均基金份额本期利润	0.0272	0.0202
本期加权平均净值利润率	2.25%	1.72%
本期基金份额净值增长率	2.52%	2.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	349,879,283.56	41,957,719.04
期末可供分配基金份额利润	0.1667	0.1299
期末基金资产净值	2,571,887,328.48	383,614,469.24
期末基金份额净值	1.2251	1.1876
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	38.11%	33.62%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

4、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

景顺长城景盈双利债券 A 类

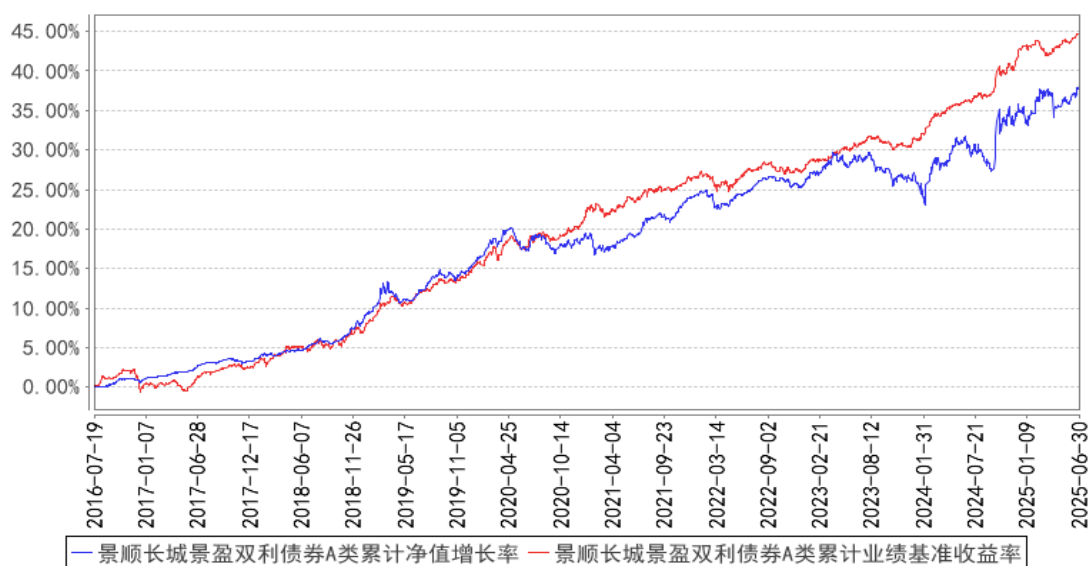
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	1.45%	0.14%	0.73%	0.05%	0.72%	0.09%
过去三个月	0.86%	0.28%	1.74%	0.08%	-0.88%	0.20%
过去六个月	2.52%	0.29%	1.04%	0.10%	1.48%	0.19%
过去一年	5.82%	0.35%	6.07%	0.14%	-0.25%	0.21%
过去三年	10.71%	0.25%	13.27%	0.11%	-2.56%	0.14%
自基金合同生效起至今	38.11%	0.18%	44.63%	0.12%	-6.52%	0.06%

景顺长城景盈双利债券 C 类

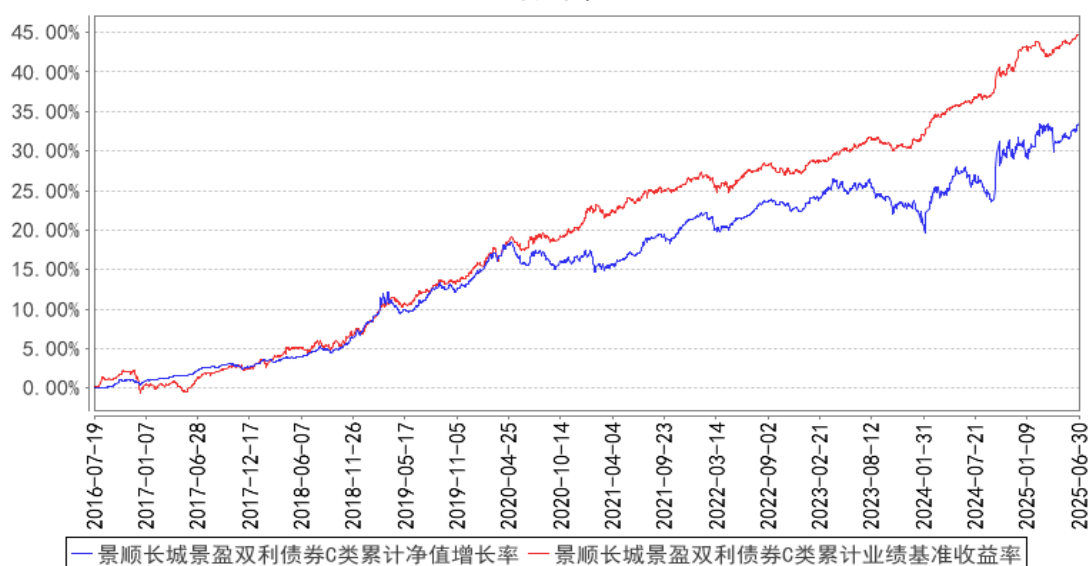
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	1.41%	0.14%	0.73%	0.05%	0.68%	0.09%
过去三个月	0.76%	0.28%	1.74%	0.08%	-0.98%	0.20%
过去六个月	2.31%	0.29%	1.04%	0.10%	1.27%	0.19%
过去一年	5.39%	0.35%	6.07%	0.14%	-0.68%	0.21%
过去三年	9.67%	0.25%	13.27%	0.11%	-3.60%	0.14%
自基金合同生效起至今	33.62%	0.17%	44.63%	0.12%	-11.01%	0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

景顺长城景盈双利债券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



景顺长城景盈双利债券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 2016 年 7 月 19 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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2025年6月30日，本公司旗下共管理199只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李 滋 源	本基金的基金助理	2022 年 12 月 23 日	-	7 年	理学硕士。曾任中金基金管理有限公司权益部研究员、基金经理助理。2022年4月加入本公司，担任养老及资产配置部研究员，自2022年12月起担任养老及资产配置部基金经理助理。具有7年证券、基金行业从业经验。
陈 静	本基金的基金经理	2023 年 8 月 19 日	-	20 年	经济学硕士。曾任中国人寿再保险股份有限公司投资部投资经理助理，中国人寿资产管理有限公司养老金及机构业务部投资经理，中国人寿养老保险股份有限公司养老保障业务机构部负责人、资深投资经理。2023年5月加入本公司，担任养老及资产配置部副总经理，自2023年8月起担任养老及资产配置部基金经理，现任养老及资产配置部副总经理、基金经理。具有20年证券、基金行业从业经验。
王 博 瑞	本基金的基金经理	2024 年 1 月 9 日	-	14 年	理学硕士，FRM。曾任中国人寿养老保险股份有限公司组合管理部组合经理、固定收益投资部投资经理，招商财富资产管理有限公司北京事业部副总经理、股债混合投

					资经理。2023 年 6 月加入本公司，自 2024 年 1 月起担任养老及资产配置部基金经理。具有 14 年证券、基金行业从业经验。
王勇	本基金的基金经理	2024 年 11 月 27 日	-	20 年	经济学博士。曾任长江证券资产管理事业部投资经理，嘉吉投资投资部项目经理，新华资产基金投资部总经理。2022 年 9 月加入本公司，担任公司总经理助理、首席资产配置官、养老及资产配置部总经理，自 2023 年 9 月起担任养老及资产配置部基金经理，现任公司总经理助理、首席资产配置官、养老及资产配置部总经理、基金经理。具有 20 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。

4.1.3 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、《景顺长城景盈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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，均为指数量化投资组合因投资策略需

要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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2025 年上半年 GDP 录得 5.3%，二季度经济数据较一季度边际回落，但总体在政策加持下仍具备韧性。消费在以旧换新政策的支持下延续亮眼表现，而投资端压力较大，房地产重现新一轮下行压力，总体价格则延续低迷表现，经济内生动能仍有待进一步加强。展望未来，在抢出口效应退潮后，预计外需进一步降温回落，高频数据指向出口已经有走弱的迹象，外需回落同时也会拖累出口相关部门的生产和就业情况，叠加房价重现下行压力，均对居民消费形成拖累，叠加金融数据作为领先指标指向后续实体经济活动将进一步降温，因此，三季度经济或面临下行压力，需要政策端给予对冲。政策方面，当前政策力度边际有所收敛，但政策空间依旧充足，政策或根据经济形势进一步发力，但中美谈判预期改善背景下，政策节奏预计或有所放缓。

权益方面，2025 年上半年市场呈现 N 型走势，主要宽基指数均录得上涨。一季度，由于 DeepSeek 催化了市场对国内科技突破和经济结构转型的乐观预期，同时叠加海外市场“美国例外论”叙事的退潮，科技板块引领 A 股、港股整体上涨。二季度，受美国对全球加征关税的消息面冲击，市场出现短期大幅下跌，但随后在关税缓和预期、内需政策对冲期权、以及资金面相对宽松充裕的背景下，市场企稳回暖、逐步回升至三月初高点。结构方面，春节期间，DeepSeek 在 AI 层面的突破催化了国内外资金对中国科技资产的重估，以 AI 和机器人为代表的科技板块成为春季躁动行情的领涨方向。另一方面，在市场风险偏好较高的背景下，红利风格整体承压。二季度，科技板块进入产业催化相对较少的观察窗口，市场从前期的广泛挖掘回归到聚焦业绩确定性，与海外算力相关的板块成为短期市场共识、录得较大上涨；往下半年看，科技仍然是最值得研究的方向之一，重点关注 AI 应用、机器人、半导体、军工等板块。二季度的另一个重要方向是“新消费”，尽管短期可能进入消化估值的阶段，但经济结构转型背景下的消费新趋势已愈发明显，持续挖掘具备新产品、新渠道、符合新需求的消费品标的，可能成为未来最重要的研究方向之一。

固收市场方面，1 月债券收益率曲线进一步平坦化，长端下行后震荡为主。全月围绕资金面进行博弈，月中资金面紧张程度达到峰值，显著超越利率走廊上限，随后央行开始公开市场投放，资金面略有好转。2 月债券收益率曲线平坦化上行，长端月中开始出现调整。全月焦点仍是资金面，尽管本月资金面峰值并未超过上月，但整体仍然处于利率走廊偏高位置，资金面整体仍然偏紧，直至月末有转松迹象。3 月债券收益率先上后下。在资金面持续偏紧以及调整中市场对消息面利空较为敏感，10 年期国债收益率最高上行至 1.90%。随着央行重回净投放，资金利率开始有

所下行后，10 年期国债收益率开始出现下行，逐步回落至 1.80%左右。4 月初债券收益率月初大幅下行后进入低位震荡。在 4 月 2 日特朗普超预期关税影响下，10 年国债收益率大幅下行。除关税战带来的全球衰退预期、风险偏好回落以外，美元走弱、人民币汇率压力降低、银行行间资金面转松也对债市形成了支撑，债券收益率低位震荡。5 月债券收益率有所震荡上行。受到 5 月 12 日中美联合声明，取消大部分对等关税，由于谈判结果大幅好于市场预期，因此债市出现调整。但考虑到当前实际关税水平依然较高，且谈判仍有不确定性，叠加资金面转为宽松，抵消了部分调整压力。6 月债券收益率重回震荡下行。由于央行对资金面较为呵护，大行净融出接近历史高位，跨季资金面环境较为宽松。同时经济基本面开始出现边际弱化迹象，支撑了债券收益率小幅震荡下行。

4.4.2 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 2.52%，业绩比较基准收益率为 1.04%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 2.31%，业绩比较基准收益率为 1.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，等待中美关税谈判、国内内需政策等关键因素的落地，后续可能存在一轮由确定性回升驱动的风险偏好回暖行情，结构上继续重点关注科技、新消费、以及部分高股息方向。固收方面，基本面仍面临下行压力，资金面在汇率压力较低下有望延续宽松，中美谈判预期改善背景下，增量政策节奏预计有所放缓，预计三季度宏观环境对债市较为有利。但四季度国内或将迎来增量政策，同时海外政策也将进入加速落地期，宏观环境或对债市形成一定压力。

权益操作方面，2025 年一季度本基金股票组合以中性偏积极的仓位运行，结构上采用多策略的运作模式。整体结构上，一季度以适度仓位积极布局了以 AI 和机器人为代表的科技板块，并在盈利达到目标后逐步止盈。二季度本基金以中性偏积极仓位运作，持仓相对均衡，主要配置了资源品、军工、医药等方向。当前组合配置结构相对均衡，计划开始适度止盈部分短期涨幅较大的持仓，布局中报景气度较高、估值适宜的方向。

固收操作方面，年初资金面持续紧张态势下，杠杆操作的意义已不大，因此前两个月逐步降低了组合杠杆，组合久期也降至较低水平，以 1-2 年期高等级信用债为主要配置方向。3 月中旬以来，随着资金面改善，逐步提高了组合杠杆率和组合久期，并加强长久期利率债波段操作。二季度资金面总体宽松背景下，总体较一季度提高了杠杆率，以 3-5 年期高等级信用债为主要配置方向，获取杠杆息差收益。同时，对长久期利率债加强了波段操作，在利率下行至低位时加大长久期利率债卖出力度，在利率调整阶段加大长久期利率债买入力度。未来在资金利率较低阶段，我们仍将维持中高杠杆水平，力争为账户获取套息收益。同时，逢利率调整阶段加大长久期利率

债买入力度，对利率债加强波段操作。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金

法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城景盈双利债券型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	652,677.20	6,453,501.04
结算备付金		13,951,073.99	7,789,448.18
存出保证金		229,985.60	226,295.26
交易性金融资产	6.4.7.2	3,502,439,737.33	2,002,300,868.13
其中：股票投资		584,871,689.93	338,034,601.94
基金投资		-	-
债券投资		2,917,568,047.40	1,664,266,266.19
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	25,500,000.00	50,401,674.14
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-

应收清算款		8,231,504.95	1,579,619.25
应收股利		-	-
应收申购款		30,254,797.09	381,090.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		3,581,259,776.16	2,069,132,496.56
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		614,944,777.66	282,022,577.25
应付清算款		5,730,843.89	7,765,089.99
应付赎回款		3,090,026.03	104,382.06
应付管理人报酬		717,881.51	428,447.89
应付托管费		239,293.85	142,815.96
应付销售服务费		119,158.11	9,727.95
应付投资顾问费		-	-
应交税费		122,815.54	95,697.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	793,181.85	568,496.64
负债合计		625,757,978.44	291,137,234.91
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	2,422,315,077.86	1,488,820,101.28
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	533,186,719.86	289,175,160.37
净资产合计		2,955,501,797.72	1,777,995,261.65
负债和净资产总计		3,581,259,776.16	2,069,132,496.56

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,422,315,077.86 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.2251 元，基金份额 2,099,321,004.17 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.1876 元，基金份额 322,994,073.69 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城景盈双利债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		63,843,686.14	44,022,212.40

1. 利息收入		360,233.37	357,125.59
其中：存款利息收入	6.4.7.13	64,750.12	244,706.13
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		295,483.25	112,419.46
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		37,311,008.02	22,052,943.47
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-8,521,482.61	-11,453,785.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	39,491,953.26	28,626,232.78
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	6,340,537.37	4,880,495.95
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	26,127,356.84	21,604,799.36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	45,087.91	7,343.98
减：二、营业总支出		7,568,949.28	10,591,396.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,771,143.42	2,848,976.59
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,257,047.82	949,658.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	433,722.73	101,169.74
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,908,020.71	6,468,114.38
其中：卖出回购金融资产支出		1,908,020.71	6,468,114.38
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		68,348.36	78,089.25
8. 其他费用	6.4.7.23	130,666.24	145,387.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		56,274,736.86	33,430,815.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		56,274,736.86	33,430,815.68

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		56,274,736.86	33,430,815.68

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城景盈双利债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,488,820,101.28	-	289,175,160.37	1,777,995,261.65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,488,820,101.28	-	289,175,160.37	1,777,995,261.65
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	933,494,976.58	-	244,011,559.49	1,177,506,536.07
(一)、综合收益总额	-	-	56,274,736.86	56,274,736.86
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	933,494,976.58	-	187,736,822.63	1,121,231,799.21
其中：1. 基金申购款	1,353,951,710.52	-	270,326,747.86	1,624,278,458.38
2. 基金赎回款	-420,456,733.94	-	-82,589,925.23	-503,046,659.17
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合	-	-	-	-

收益结转留存收益				
四、本期期末净资产	2,422,315,077.86	-	533,186,719.86	2,955,501,797.72
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,714,480,738.90	-	352,124,345.13	2,066,605,084.03
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,714,480,738.90	-	352,124,345.13	2,066,605,084.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	347,276,442.56	-	-27,611,660.35	319,664,782.21
（一）、综合收益总额	-	-	33,430,815.68	33,430,815.68
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	347,276,442.56	-	104,717,887.18	451,994,329.74
其中：1. 基金申购款	859,721,479.90	-	203,917,269.89	1,063,638,749.79
2. 基金赎回款	-512,445,037.34	-	-99,199,382.71	-611,644,420.05
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-165,760,363.21	-165,760,363.21
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,061,757,181.46	-	324,512,684.78	2,386,269,866.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>康乐</u>	<u>吴建军</u>	<u>邵媛媛</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城景盈双利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]第 842 号《关于准予景顺长城景盈双利债券型证券投资基金注册的批复》核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景盈双利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 311,256,065.26 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2016）第 892 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城景盈双利债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 311,356,388.87 份基金份额，其中认购资金利息折合 100,323.61 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《景顺长城景盈双利债券型证券投资基金基金合同》和《景顺长城景盈双利债券型证券投资基金招募说明书》，本基金自募集期起根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费的，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但不同类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景盈双利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券（含分离型可转换债券）、银行存款等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后

允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款。基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率 $\times$ 90%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 10%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2025 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税（如适用）

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	652,677.20
等于：本金	652,608.89
加：应计利息	68.31

减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1 个月（含）-3 个月	-
存款期限 3 个月（含）至 1 年	-
存款期限 1 年（含）以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	652,677.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		562,973,575.41	-	584,871,689.93	21,898,114.52
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	458,509,288.00	5,594,817.79	467,130,327.79	3,026,222.00
	银行间市场	2,413,090,243.17	23,211,719.61	2,450,437,719.61	14,135,756.83
	合计	2,871,599,531.17	28,806,537.40	2,917,568,047.40	17,161,978.83
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,434,573,106.58	28,806,537.40	3,502,439,737.33	39,060,093.35

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	25,500,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	25,500,000.00	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	40.39
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	692,101.61
其中：交易所市场	667,169.08
银行间市场	24,932.53
应付利息	-
预提费用	101,039.85
合计	793,181.85

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城景盈双利债券 A 类

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,453,215,614.22	1,453,215,614.22
本期申购	928,051,750.38	928,051,750.38
本期赎回（以“-”号填列）	-281,946,360.43	-281,946,360.43
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,099,321,004.17	2,099,321,004.17

景顺长城景盈双利债券 C 类

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,604,487.06	35,604,487.06
本期申购	425,899,960.14	425,899,960.14
本期赎回（以“-”号填列）	-138,510,373.51	-138,510,373.51
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	322,994,073.69	322,994,073.69

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城景盈双利债券 A 类

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	219,317,903.10	64,129,222.50	283,447,125.60
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	219,317,903.10	64,129,222.50	283,447,125.60
本期利润	27,949,755.08	24,480,794.63	52,430,549.71
本期基金份额交易产生的变动数	102,611,625.38	34,077,023.62	136,688,649.00
其中：基金申购款	147,590,289.39	47,811,980.51	195,402,269.90
基金赎回款	-44,978,664.01	-13,734,956.89	-58,713,620.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	349,879,283.56	122,687,040.75	472,566,324.31

景顺长城景盈双利债券 C 类

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,165,010.39	1,563,024.38	5,728,034.77
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,165,010.39	1,563,024.38	5,728,034.77
本期利润	2,197,624.94	1,646,562.21	3,844,187.15
本期基金份额交易产生的变动数	35,595,083.71	15,453,089.92	51,048,173.63
其中：基金申购款	53,381,816.04	21,542,661.92	74,924,477.96
基金赎回款	-17,786,732.33	-6,089,572.00	-23,876,304.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,957,719.04	18,662,676.51	60,620,395.55

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	24,639.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	18,340.36
其他	21,770.69
合计	64,750.12

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,521,482.61
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-8,521,482.61

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	1,209,965,861.28
减：卖出股票成本总额	1,216,509,838.63
减：交易费用	1,977,505.26
买卖股票差价收入	-8,521,482.61

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	30,069,124.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,422,828.84
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	39,491,953.26

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,267,263,163.24
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,247,854,592.77
减：应计利息总额	9,926,939.47
减：交易费用	58,802.16
买卖债券差价收入	9,422,828.84

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,340,537.37
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,340,537.37

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	26,127,356.84
股票投资	29,334,018.96
债券投资	-3,206,662.12
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-

权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	26,127,356.84

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	44,874.06
基金转换费收入	213.85
合计	45,087.91

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	18,600.00
银行划款手续费	20,283.81
存托服务费	42.58
合计	130,666.24

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
--------------------	-----------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金 额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
长城证券	-	-	229,102,501.58	8.54

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
长城证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
长城证券	216,711.40	8.54	202,515.16	18.05

注：（1）上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

（2）上年度可比期间该类佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

（3）根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，本报告期内被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,771,143.42	2,848,976.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	404,130.18	146,297.49
应支付基金管理人的净管理费	3,367,013.24	2,702,679.10

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,257,047.82	949,658.84

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城景盈双利债 券 A 类	景顺长城景盈双利债 券 C 类	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	98,903.78	98,903.78
中国建设银行	-	3,356.63	3,356.63
长城证券	-	-	-
合计	-	102,260.41	102,260.41
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城景盈双利债 券 A 类	景顺长城景盈双利债 券 C 类	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	29,243.91	29,243.91

司			
中国建设银行	-	5,130.39	5,130.39
长城证券	-	-	-
合计	-	34,374.30	34,374.30

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行－活期	652,677.20	24,639.07	7,555,405.14	42,554.11

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 471,244,777.66 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
112522014	25 邮储银行 CD014	2025 年 7 月 1 日	99.35	1,000,000	99,345,180.43
220205	22 国开 05	2025 年 7 月 1 日	109.19	800,000	87,348,931.51
220220	22 国开 20	2025 年 7 月 1 日	108.91	353,000	38,444,262.88
240205	24 国开 05	2025 年 7 月 1 日	108.05	1,000,000	108,053,753.42
240210	24 国开 10	2025 年 7 月 1 日	105.11	1,500,000	157,665,821.92
250411	25 农发 11	2025 年 7 月 1 日	100.57	264,000	26,551,340.71
合计				4,917,000	517,409,290.87

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 143,700,000.00 元，于 2025 年 7 月 1 日前（含当日）先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风

险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 77.94%（上年度末：87.87%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风

险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	652,677.20	-	-	-	-	-	652,677.20
结算备付金	13,951,073.99	-	-	-	-	-	13,951,073.99
存出保证金	229,985.60	-	-	-	-	-	229,985.60
交易性金融资产	-	62,231,525.59	429,360,239.61	1,516,316,984.11	909,659,298.09	584,871,689.93	3,502,439,737.33
买入返售金融资产	25,500,000.00	-	-	-	-	-	25,500,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-	30,254,797.09	30,254,797.09
应收清算款	-	-	-	-	-	8,231,504.95	8,231,504.95
资产总计	40,333,736.79	62,231,525.59	429,360,239.61	1,516,316,984.11	909,659,298.09	623,357,991.97	3,581,259,776.16
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,090,026.03	3,090,026.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	717,881.51	717,881.51
应付托管费	-	-	-	-	-	239,293.85	239,293.85
应付清算	-	-	-	-	-	5,730,843.89	5,730,843.89

算款							
卖出回 购金融 资产款	614,944,777.66	-	-	-	-	-	614,944,777.66
应付销 售服务 费	-	-	-	-	-	119,158.11	119,158.11
应交税 费	-	-	-	-	-	122,815.54	122,815.54
其他负 债	-	-	-	-	-	793,181.85	793,181.85
负债总 计	614,944,777.66	-	-	-	-	10,813,200.78	625,757,978.44
利率敏 感度缺 口	-574,611,040.87	62,231,525.59	429,360,239.61	1,516,316,984.11	909,659,298.09	-	-
上年度 末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资 金	6,453,501.04	-	-	-	-	-	6,453,501.04
结算备 付金	7,789,448.18	-	-	-	-	-	7,789,448.18
存出保 证金	226,295.26	-	-	-	-	-	226,295.26
交易性 金融资 产	10,198,524.59	25,778,478.02	123,902,637.87	1,302,563,681.80	201,822,943.91	338,034,601.94	2,002,300,868.13
买入返 售金融 资产	50,401,674.14	-	-	-	-	-	50,401,674.14
应收申 购款	-	-	-	-	-	381,090.56	381,090.56
应收清 算款	-	-	-	-	-	1,579,619.25	1,579,619.25
资产总 计	75,069,443.21	25,778,478.02	123,902,637.87	1,302,563,681.80	201,822,943.91	339,995,311.75	2,069,132,496.56
负债							
应付赎 回款	-	-	-	-	-	104,382.06	104,382.06
应付管	-	-	-	-	-	428,447.89	428,447.89

理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	142,815.96	142,815.96
应付清算款	-	-	-	-	-	7,765,089.99	7,765,089.99
卖出回购金融资产款	282,022,577.25	-	-	-	-	-	282,022,577.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,727.95	9,727.95
应交税费	-	-	-	-	-	95,697.17	95,697.17
其他负债	-	-	-	-	-	568,496.64	568,496.64
负债总计	282,022,577.25	-	-	-	-	9,114,657.66	291,137,234.91
利率敏感度缺口	-206,953,134.04	25,778,478.02	123,902,637.87	1,302,563,681.80	201,822,943.91	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-20,110,228.16	-7,475,040.02
	市场利率下降 25 个基点	20,407,461.71	7,539,213.33

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，

所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	584,871,689.93	19.79	338,034,601.94	19.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	584,871,689.93	19.79	338,034,601.94	19.01

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	32,056,558.92	22,041,083.40
	沪深 300 指数下降 5%	-32,056,558.92	-22,041,083.40

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可

观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	584,871,689.93	563,278,349.58
第二层次	2,917,568,047.40	1,439,022,518.55
第三层次	—	—
合计	3,502,439,737.33	2,002,300,868.13

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	584,871,689.93	16.33
	其中：股票	584,871,689.93	16.33
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,917,568,047.40	81.47
	其中：债券	2,917,568,047.40	81.47

	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	25,500,000.00	0.71
	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	14,603,751.19	0.41
8	其他各项资产	38,716,287.64	1.08
9	合计	3,581,259,776.16	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,028,813.00	0.03
B	采矿业	45,931,225.50	1.55
C	制造业	354,627,040.87	12.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,886,246.00	0.27
E	建筑业	594,310.00	0.02
F	批发和零售业	13,223,130.00	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	18,547,812.00	0.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,579,093.30	0.59
J	金融业	94,907,662.00	3.21
K	房地产业	284,406.00	0.01
L	租赁和商务服务业	8,657,837.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	21,066,226.26	0.71
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	537,888.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	584,871,689.93	19.79

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	601336	新华保险	525,500	30,741,750.00	1.04
2	300274	阳光电源	446,720	30,274,214.40	1.02
3	601100	恒立液压	383,300	27,597,600.00	0.93
4	601857	中国石油	2,762,200	23,616,810.00	0.80
5	600498	烽火通信	1,094,296	23,013,044.88	0.78
6	601899	紫金矿业	1,083,000	21,118,500.00	0.71
7	603259	药明康德	294,400	20,475,520.00	0.69
8	000063	中兴通讯	570,900	18,548,541.00	0.63
9	601111	中国国航	2,350,800	18,547,812.00	0.63
10	601211	国泰海通	901,000	17,263,160.00	0.58
11	300633	开立医疗	576,200	17,124,664.00	0.58
12	000960	锡业股份	987,300	15,105,690.00	0.51
13	688717	艾罗能源	271,717	14,626,526.11	0.49
14	688281	华秦科技	211,688	12,809,240.88	0.43
15	688239	航宇科技	339,761	11,884,839.78	0.40
16	000617	中油资本	1,587,800	11,590,940.00	0.39
17	688403	汇成股份	1,106,801	11,499,662.39	0.39
18	600316	洪都航空	276,600	10,427,820.00	0.35
19	688037	芯源微	93,227	9,993,934.40	0.34
20	600961	株冶集团	824,700	9,220,146.00	0.31
21	300260	新莱应材	273,400	8,989,392.00	0.30
22	300395	菲利华	175,300	8,957,830.00	0.30
23	000065	北方国际	744,500	8,785,100.00	0.30
24	688582	芯动联科	128,661	8,646,019.20	0.29
25	000933	神火股份	493,700	8,215,168.00	0.28
26	688590	新致软件	391,195	8,035,145.30	0.27
27	603267	鸿远电子	131,000	6,585,370.00	0.22
28	688002	睿创微纳	90,993	6,344,031.96	0.21
29	601318	中国平安	109,000	6,047,320.00	0.20
30	000534	万泽股份	358,100	5,342,852.00	0.18
31	002901	大博医疗	147,000	5,327,280.00	0.18
32	600873	梅花生物	490,100	5,239,169.00	0.18
33	600391	航发科技	172,300	5,031,160.00	0.17
34	600153	建发股份	480,100	4,978,637.00	0.17
35	601328	交通银行	615,100	4,920,800.00	0.17
36	000685	中山公用	557,100	4,891,338.00	0.17
37	600015	华夏银行	618,300	4,890,753.00	0.17
38	300770	新媒股份	116,700	4,666,833.00	0.16
39	601825	沪农商行	465,300	4,513,410.00	0.15
40	600398	海澜之家	634,200	4,414,032.00	0.15
41	600019	宝钢股份	634,900	4,183,991.00	0.14
42	600519	贵州茅台	2,900	4,087,608.00	0.14

43	688627	精智达	45,839	4,034,290.39	0.14
44	000858	五 粮 液	32,400	3,852,360.00	0.13
45	600219	南山铝业	988,100	3,784,423.00	0.13
46	000651	格力电器	82,900	3,723,868.00	0.13
47	002027	分众传媒	504,000	3,679,200.00	0.12
48	601166	兴业银行	156,500	3,652,710.00	0.12
49	000733	振华科技	72,300	3,618,615.00	0.12
50	601229	上海银行	340,900	3,616,949.00	0.12
51	000538	云南白药	64,700	3,609,613.00	0.12
52	600998	九州通	687,700	3,534,778.00	0.12
53	600887	伊利股份	121,700	3,392,996.00	0.11
54	600050	中国联通	458,600	2,448,924.00	0.08
55	601319	中国人保	260,200	2,266,342.00	0.08
56	300750	宁德时代	8,900	2,244,758.00	0.08
57	000690	宝新能源	491,600	2,236,780.00	0.08
58	601688	华泰证券	125,100	2,228,031.00	0.08
59	002001	新 和 成	94,400	2,007,888.00	0.07
60	600585	海螺水泥	91,500	1,964,505.00	0.07
61	600036	招商银行	33,000	1,516,350.00	0.05
62	600030	中信证券	42,900	1,184,898.00	0.04
63	002594	比亚迪	3,200	1,062,112.00	0.04
64	000333	美的集团	13,800	996,360.00	0.03
65	000100	TCL 科技	226,500	980,745.00	0.03
66	688183	生益电子	17,218	881,561.60	0.03
67	300476	胜宏科技	6,200	833,156.00	0.03
68	002714	牧原股份	17,700	743,577.00	0.03
69	688591	泰凌微	15,457	740,390.30	0.03
70	600941	中国移动	6,500	731,575.00	0.02
71	688049	炬芯科技	11,191	677,055.50	0.02
72	600028	中国石化	117,000	659,880.00	0.02
73	002487	大金重工	19,500	641,550.00	0.02
74	603236	移远通信	7,400	634,920.00	0.02
75	688668	鼎通科技	10,079	629,534.34	0.02
76	300913	兆龙互连	13,440	629,260.80	0.02
77	301061	匠心家居	8,050	624,197.00	0.02
78	603063	禾望电气	18,300	619,638.00	0.02
79	002080	中材科技	31,000	604,500.00	0.02
80	300850	新强联	16,700	598,194.00	0.02
81	600183	生益科技	19,800	596,970.00	0.02
82	601668	中国建筑	103,000	594,310.00	0.02
83	002202	金风科技	57,000	584,250.00	0.02
84	600436	片仔癀	2,900	580,029.00	0.02
85	600900	长江电力	19,000	572,660.00	0.02

86	300113	顺网科技	28,900	571,064.00	0.02
87	002138	顺络电子	19,900	559,588.00	0.02
88	000157	中联重科	76,200	550,926.00	0.02
89	688333	铂力特	9,245	550,632.20	0.02
90	300015	爱尔眼科	43,100	537,888.00	0.02
91	002155	湖南黄金	30,030	536,035.50	0.02
92	600166	福田汽车	196,500	532,515.00	0.02
93	688428	诺诚健华	21,762	531,645.66	0.02
94	600031	三一重工	29,400	527,730.00	0.02
95	000528	柳 工	54,700	525,667.00	0.02
96	600882	妙可蓝多	17,000	519,010.00	0.02
97	603596	伯特利	9,800	516,362.00	0.02
98	002946	新乳业	26,200	491,774.00	0.02
99	300972	万辰集团	2,700	486,648.00	0.02
100	601658	邮储银行	86,700	474,249.00	0.02
101	300973	立高食品	9,700	473,069.00	0.02
102	000725	京东方 A	117,000	466,830.00	0.02
103	688608	恒玄科技	1,333	463,857.34	0.02
104	600104	上汽集团	27,800	446,190.00	0.02
105	600690	海尔智家	17,300	428,694.00	0.01
106	601360	三六零	41,300	421,260.00	0.01
107	601607	上海医药	23,300	416,604.00	0.01
108	002230	科大讯飞	7,900	378,252.00	0.01
109	002991	甘源食品	6,000	374,820.00	0.01
110	603605	珀莱雅	4,500	372,555.00	0.01
111	300037	新宙邦	9,500	334,400.00	0.01
112	300383	光环新网	22,800	326,040.00	0.01
113	301268	铭利达	17,100	317,205.00	0.01
114	002532	天山铝业	38,000	315,780.00	0.01
115	688087	英科再生	11,885	305,444.50	0.01
116	688238	和元生物	48,892	303,130.40	0.01
117	600055	万东医疗	17,300	298,944.00	0.01
118	301029	怡合达	12,900	294,894.00	0.01
119	002984	森麒麟	15,700	294,375.00	0.01
120	301589	诺瓦星云	2,000	290,660.00	0.01
121	002158	汉钟精机	16,700	290,246.00	0.01
122	000401	冀东水泥	65,700	287,766.00	0.01
123	688248	南网科技	9,141	287,575.86	0.01
124	689009	九号公司	4,852	287,092.84	0.01
125	301367	瑞迈特	3,400	285,940.00	0.01
126	600761	安徽合力	16,100	285,614.00	0.01
127	603027	千禾味业	24,600	285,606.00	0.01
128	300498	温氏股份	16,700	285,236.00	0.01

129	600499	科达制造	29,100	285,180.00	0.01
130	000932	华菱钢铁	64,800	285,120.00	0.01
131	000002	万 科 A	44,300	284,406.00	0.01
132	605138	盛泰集团	42,400	284,080.00	0.01
133	603317	天味食品	25,500	283,560.00	0.01
134	688516	奥特维	8,485	282,041.40	0.01
135	600419	天润乳业	28,400	280,592.00	0.01
136	002959	小熊电器	5,900	273,996.00	0.01
137	002597	金禾实业	11,500	270,825.00	0.01
138	603566	普莱柯	19,800	269,478.00	0.01
139	002568	百润股份	10,400	266,344.00	0.01
140	600612	老凤祥	5,300	263,675.00	0.01
141	600702	舍得酒业	4,800	246,720.00	0.01
142	600276	恒瑞医药	3,700	192,030.00	0.01
143	601985	中国核电	19,900	185,468.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300274	阳光电源	29,743,376.00	1.67
2	688239	航宇科技	25,714,141.11	1.45
3	600498	烽火通信	24,659,196.60	1.39
4	300395	菲利华	23,641,132.00	1.33
5	000063	中兴通讯	23,410,686.00	1.32
6	601100	恒立液压	22,540,589.00	1.27
7	601857	中国石油	22,322,382.00	1.26
8	000975	山金国际	21,732,774.00	1.22
9	601211	国泰海通	19,838,321.82	1.12
10	601336	新华保险	19,173,752.00	1.08
11	688403	汇成股份	18,807,977.27	1.06
12	688717	艾罗能源	18,191,517.18	1.02
13	600316	洪都航空	18,176,749.00	1.02
14	601111	中国国航	18,003,899.00	1.01
15	300633	开立医疗	17,903,583.00	1.01
16	688190	云路股份	17,421,654.90	0.98
17	300406	九强生物	15,573,038.00	0.88
18	600519	贵州茅台	15,270,614.00	0.86
19	000960	锡业股份	15,062,320.00	0.85
20	603882	金域医学	14,999,463.00	0.84

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600602	云赛智联	30,148,468.00	1.70
2	000975	山金国际	21,568,987.60	1.21
3	002475	立讯精密	21,228,407.00	1.19
4	300395	菲利华	17,935,947.00	1.01
5	600584	长电科技	17,655,636.00	0.99
6	000933	神火股份	17,089,157.00	0.96
7	688190	云路股份	16,781,203.72	0.94
8	601138	工业富联	15,562,822.88	0.88
9	688403	汇成股份	15,505,571.95	0.87
10	688076	ST 诺泰	15,195,959.56	0.85
11	603920	世运电路	14,758,492.02	0.83
12	601100	恒立液压	14,240,555.00	0.80
13	688239	航宇科技	13,504,710.79	0.76
14	603283	赛腾股份	13,301,068.00	0.75
15	002223	鱼跃医疗	13,102,325.00	0.74
16	688776	国光电气	13,075,509.04	0.74
17	300406	九强生物	12,849,326.00	0.72
18	300059	东方财富	12,604,586.00	0.71
19	601088	中国神华	12,578,077.00	0.71
20	603882	金域医学	12,502,351.00	0.70

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,434,012,907.66
卖出股票收入（成交）总额	1,209,965,861.28

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	14,260,281.21	0.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,278,760,064.66	43.27
	其中：政策性金融债	599,675,350.69	20.29
4	企业债券	527,005,329.32	17.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	998,197,191.78	33.77

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	99,345,180.43	3.36
9	其他	-	-
10	合计	2,917,568,047.40	98.72

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	240210	24 国开 10	1,500,000	157,665,821.92	5.33
2	240205	24 国开 05	1,000,000	108,053,753.42	3.66
3	232580006	25 民生银行二 级资本债 01	1,000,000	100,855,095.89	3.41
4	112522014	25 邮储银行 CD014	1,000,000	99,345,180.43	3.36
5	220205	22 国开 05	800,000	87,348,931.51	2.96

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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分局的处罚。

中国邮政储蓄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。

7.11.2 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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	229,985.60
2	应收清算款	8,231,504.95
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,254,797.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,716,287.64

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
景顺长城 景盈双利 债券 A 类	710	2,956,790.15	2,092,074,005.25	99.65	7,246,998.92	0.35
景顺长城 景盈双利 债券 C 类	1,464	220,624.37	297,770,992.83	92.19	25,223,080.86	7.81
合计	2,174	1,114,220.37	2,389,844,998.08	98.66	32,470,079.78	1.34

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采

用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	景顺长城景盈双利债券 A 类	193,369.70	0.009211
	景顺长城景盈双利债券 C 类	176.78	0.000055
	合计	193,546.48	0.007990

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	景顺长城景盈双利债券 A 类	10~50
	景顺长城景盈双利债券 C 类	—
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城景盈双利债券 A 类	0~10
	景顺长城景盈双利债券 C 类	—
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城景盈双利债券 A 类	景顺长城景盈双利债券 C 类
基金合同生效日 （2016 年 7 月 19 日） 基金份额总额	183,718,499.98	127,637,888.89
本报告期期初基金份额总额	1,453,215,614.22	35,604,487.06
本报告期基金总申购份额	928,051,750.38	425,899,960.14
减：本报告期基金总赎回份额	281,946,360.43	138,510,373.51
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	2,099,321,004.17	322,994,073.69

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

本基金管理人于 2025 年 4 月 2 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任卫学文先生担任本公司副总经理。

本基金管理人于 2025 年 5 月 30 日发布公告，因李进董事长任期届满，由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。本基金管理人于 2025 年 8 月 6 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任叶才先生担任本公司董事长。本基金管理人于 2025 年 8 月 15 日发布公告，经深圳市市场监督管理局核准，景顺长城基金管理有限公司法定代表人变更为叶才先生。

有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券股份有限公司	1	410,864,178.73	15.54	186,943.24	15.54	未变更
中信证券股份有限公司	4	284,574,971.41	10.76	129,481.50	10.76	未变更
浙商证券股份有限公司	2	259,033,717.54	9.80	117,860.70	9.80	未变更
华创证券有限责任公司	1	231,043,931.11	8.74	105,125.00	8.74	未变更
光大证券股份有限公司	2	209,156,292.12	7.91	95,166.15	7.91	未变更
招商证券股份有限公司	1	176,448,554.07	6.67	80,284.13	6.67	未变更
国信证券股份有限公司	2	174,151,942.33	6.59	79,239.11	6.59	未变更
中国国际金融股份有限公司	1	154,833,591.00	5.86	70,450.23	5.86	未变更
中信建投证券股份有限公司	1	143,339,163.06	5.42	65,219.97	5.42	未变更
方正证券股份有限	1	141,659,151.00	5.36	64,455.37	5.36	未变更

公司						
国泰海通证券股份有限公司	1	140,064,205.59	5.30	63,730.53	5.30	未变更
民生证券股份有限公司	2	130,241,555.35	4.93	59,260.44	4.93	未变更
东方证券股份有限公司	1	69,604,797.00	2.63	31,669.75	2.63	未变更
国联民生证券股份有限公司	1	47,346,003.60	1.79	21,542.29	1.79	未变更
汇丰前海证券有限责任公司	1	43,695,969.00	1.65	19,882.12	1.65	未变更
中泰证券股份有限公司	1	13,340,196.70	0.50	6,069.78	0.50	未变更
西部证券股份有限公司	2	9,694,013.56	0.37	4,410.76	0.37	未变更
华福证券有限责任公司	1	4,886,535.77	0.18	2,223.38	0.18	未变更
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
长城证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
华金证券	2	-	-	-	-	未变更

股份有限 公司						更
华源证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	本期 报告 新增 2 个
摩根大通 证券（中 国）有限公 司	1	-	-	-	-	本期 报告 新增 1 个
天风证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
湘财证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	未变 更
中银国际 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	未变 更

注：1、基金管理人选择交易单元的标准为：交易单元所属券商财务状况良好，经营行为规范，合
规风控能力和交易、研究等服务能力较强。

2、基金管理人选择交易单元参与证券交易的程序为：基金管理人定期对符合上述标准的券商
进行测评，测评结果是决定后期使用各证券公司交易单元参与证券交易的依据。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券 成交总 额的比例 (%)	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的比例 (%)	成交金 额	占当期 权证 成交总 额的比例 (%)
广发证券 股份有限 公司	263,657,827.59	22.35	1,725,785,000.00	14.61	-	-
中信证券 股份有限 公司	21,534,672.45	1.83	1,115,200,000.00	9.44	-	-
浙商证券 股份有限 公司	62,676,565.98	5.31	723,700,000.00	6.13	-	-
华创证券	115,499,519.78	9.79	783,600,000.00	6.63	-	-

有限责任 公司						
光大证券 股份有限 公司	29,934,332.88	2.54	1,934,400,000.00	16.37	-	-
招商证券 股份有限 公司	89,358,411.66	7.57	530,100,000.00	4.49	-	-
国信证券 股份有限 公司	131,095,920.22	11.11	2,036,500,000.00	17.24	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	197,388,742.76	16.73	427,600,000.00	3.62	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	90,593,197.58	7.68	239,400,000.00	2.03	-	-
方正证券 股份有限 公司	-	-	312,000,000.00	2.64	-	-
国泰海通 证券股份 有限公司	102,668,531.11	8.70	288,700,000.00	2.44	-	-
民生证券 股份有限 公司	10,188,357.59	0.86	384,500,000.00	3.25	-	-
东方证券 股份有限 公司	48,799,718.73	4.14	617,900,000.00	5.23	-	-
国联民生 证券股份 有限公司	-	-	134,000,000.00	1.13	-	-
汇丰前海 证券有限 责任公司	-	-	131,300,000.00	1.11	-	-
中泰证券 股份有限 公司	-	-	195,700,000.00	1.66	-	-
西部证券 股份有限 公司	1,823,549.10	0.15	40,500,000.00	0.34	-	-
华福证券 有限责任 公司	14,486,561.02	1.23	194,000,000.00	1.64	-	-

渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券（中国）有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中邮证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 2 日
2	关于不法分子冒用景顺长城基金 APP 及员工名义进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 3 日

3	关于不法分子冒用景顺长城基金 APP 及员工名义进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 3 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 6 日
5	景顺长城景盈双利债券型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 22 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 22 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 2 月 25 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 17 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 19 日
10	景顺长城景盈双利债券型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 28 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 28 日
12	景顺长城基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 31 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 2 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 14 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 15 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 22 日
17	景顺长城景盈双利债券型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 22 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 23 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 12 日
20	关于不法分子冒用景顺长城基金及股东方 APP 进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 20 日
21	关于不法分子冒用景顺长城基金及股东方 APP 进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 20 日
22	景顺长城景盈双利债券型证券投资基金 2025 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 24 日
23	景顺长城景盈双利债券型证券投资基	中国证监会指定报刊及	2025 年 5 月 24 日

	金基金产品资料概要更新	网站	
24	景顺长城基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 30 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 30 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 3 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20250101-20250630	426, 105, 835. 77	274, 926, 347. 24	24, 138, 200. 36	676, 893, 982. 65	27. 94

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 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 8 月 29 日