

景顺长城安悦 180 天持有期债券型证券投资  
基金  
2026 年第 2 季度报告

2026 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 07 月 20 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 2026 年 04 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 景顺长城安悦 180 天持有期债券                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 基金主代码      | 024281                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 基金合同生效日    | 2025 年 7 月 24 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 报告期末基金份额总额 | 132,181,295.82 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 投资目标       | 本基金主要通过投资于固定收益品种，在严格控制风险的基础上，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>（一）资产配置策略</p> <p>本基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况进行调整，资产配置组合主要以债券等固定收益类资产配置为主，并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例，使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上优化投资组合。</p> <p>（二）债券投资策略</p> <p>债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用债投资策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>（三）国债期货投资策略</p> <p>本基金可基于谨慎原则，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>（四）信用衍生品投资策略</p> <p>本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。同时，本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理，合理分散交易对手方、创设机构的集中度，对交易对手方、创设机构的财务状况、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。</p> <p>（五）可转换债券与可交换债券投资策略</p> <p>本基金投资可转换债券和可交换债券合计不超过基金资产的 20%。</p> <p>1、可转换债券投资策略</p> <p>（1）相对价值分析：基金管理人根据定期公布的宏观和金融数据以及对宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，判断下一阶段的市场走势，分析可转换债券股性和债性的相对价值。通过对可转换债券转股溢价率和 Delta 系数的度量，筛选出股性或债性较强的品种作为下一阶段的投资重点。（2）基本面研究：基金管理人依据内、外部研究成果，运用景顺长城股票研究数据库（SRD）对可转换债券标的公司进行多方位、多角度的分析，重点选择行业景气度较高、公司基本面素质优良的标的公司。（3）估值分析：在基本面分析的基础上，运用 PE、PB、PCF、EV/EBITDA、PEG 等相对估值指标以及 DCF、DDM 等绝对估值方法对标的公司的股票价值进行评估，并根据标的股票的当前价格和目标价格，运用期权定价模型分别计算可转换债券当前的理论价格和未来目标价格，进行投资决策。（4）本基金将通过对目标公司股票的投资价值和可交换债券的纯债部分价值进行综合分析开展投资决策。</p> <p>2、可交换债券投资策略</p> <p>可交换债券与可转换债券区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票，而是发行人持有的其他上市公司的股票。可交换债券同样具有股性和债性，其中债性与可转换债券相同，即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息；而对于股性的分析则需关注目标公司的股票价值。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价（总值）指数收益率*80%+银行一年期定期存款利率（税后）*20%。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 基金管理人  | 景顺长城基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

|                 |                     |                     |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| 基金托管人           | 中国农业银行股份有限公司        |                     |
| 下属分级基金的基金简称     | 景顺长城安悦 180 天持有期债券 A | 景顺长城安悦 180 天持有期债券 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 024281              | 024282              |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 98,973,147.25 份     | 33,208,148.57 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（2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日） |                     |
|-----------------|-------------------------------------|---------------------|
|                 | 景顺长城安悦 180 天持有期债券 A                 | 景顺长城安悦 180 天持有期债券 C |
| 1. 本期已实现收益      | 1,151,367.27                        | 299,628.14          |
| 2. 本期利润         | 5,030,697.11                        | 1,390,437.38        |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0332                              | 0.0312              |
| 4. 期末基金资产净值     | 102,369,519.22                      | 34,282,426.00       |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0343                              | 1.0323              |

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

景顺长城安悦 180 天持有期债券 A

| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月      | 3.01%  | 0.24%     | 0.57%      | 0.03%         | 2.44% | 0.21% |
| 过去六个月      | 2.77%  | 0.20%     | 0.88%      | 0.03%         | 1.89% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.43%  | 0.14%     | -0.04%     | 0.04%         | 3.47% | 0.10% |

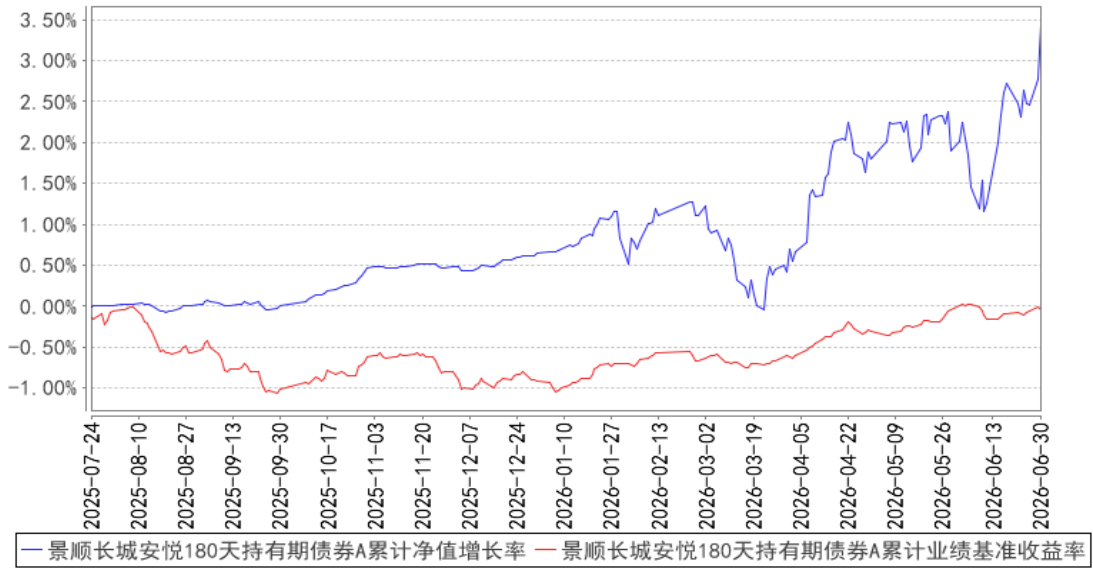
景顺长城安悦 180 天持有期债券 C

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

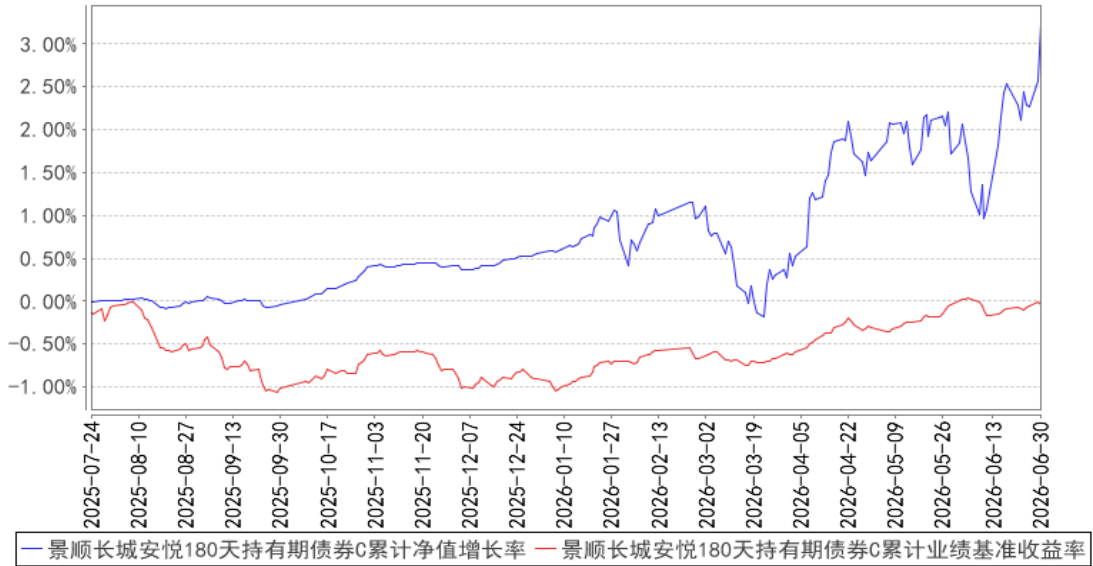
|            |       |       |        |       |       |       |
|------------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|
| 过去三个月      | 2.95% | 0.24% | 0.57%  | 0.03% | 2.38% | 0.21% |
| 过去六个月      | 2.67% | 0.20% | 0.88%  | 0.03% | 1.79% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.23% | 0.14% | -0.04% | 0.04% | 3.27% | 0.10% |

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

景顺长城安悦180天持有期债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城安悦180天持有期债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，本基金投资可转换债券和可交换债券合计不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年以内的政府债券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、应收申购款等。本基金的建仓期为自 2025 年 7 月 24 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。报告期末距离建仓结束期末满一年。基金合同生效日（2025 年 7 月 24 日）起至本报告期末不满一年。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理期限      |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                            |
|-----|----------|------------------|------|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          | 任职日期             | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                               |
| 米良  | 本基金的基金经理 | 2025 年 7 月 24 日  | -    | 12 年   | 经济学硕士，CFA。曾任汇丰银行（中国）有限公司零售银行部管理培训生、零售银行部高级客户经理，汇丰银行深圳分行贸易融资部产品经理，招商银行资产负债部资产管理岗。2018 年 9 月加入本公司，自 2018 年 11 月起担任固定收益部基金经理。具有 12 年证券、基金行业从业经验。                                                 |
| 陈静  | 本基金的基金经理 | 2025 年 12 月 13 日 | -    | 21 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 21 年证券、基金行业从业经验。 |
| 白天伟 | 本基金的基金助理 | 2025 年 12 月 20 日 | -    | 7 年    | 理学硕士。曾任国泰君安证券北京分公司建国路营业部客户经理，国联民生证券固定收益部宏观研究员。2025 年 9 月加入我公司，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。                                                                                             |

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”为公司决定且公告的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”及“离任日期”指根据公司决定且公告的聘任、解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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、《景顺长城安悦 180 天持有期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 4 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

宏观经济方面，2026 年二季度，内需全面走弱且幅度超预期，而外需在 AI 产业链带动下依旧强劲，经济 K 型分化特征进一步加剧。政策方面，二季度财政支出大幅收缩，可能是内需数据走弱的主要影响因素。货币政策保持稳定，6 月以来资金面中性偏紧。展望未来，出口韧性大概率持续，面对二季度内需加速下滑，7 月政治局会议可能重新定调，推动超长期特别国债和专项债加快发行使用，并推动政策性金融工具加快落地，这有望带动基建投资提速。但消费仍受居民就业和预期偏弱制约，预计维持低速弱修复，房地产市场预计延续“销售回暖、投资仍待企稳”的分化格局。PPI 同比涨幅受基数效应以及油价回落影响将有所放缓。整体经济将呈现“稳中承压、结构分化”的运行态势。

海外方面，6 月 FOMC 会议是新任主席沃什首秀，政策利率维持 3.5%-3.75% 不变，但会议释放了强烈鹰派信号。经济预测摘要（SEP）大幅上调 2026 年 PCE 通胀预测至 3.6%（较 3 月上调 0.9 个百分点）。点阵图显示 18 位委员中半数预计年内至少加息一次，六人预期加息两次及以上，年底利率中值上修至 3.75%，市场紧缩定价明显升温。沃什本人公开批评点阵图参考价值有限，并宣布成立五大改革工作组，覆盖沟通机制、资产负债表、数据来源、AI 生产率与就业、通胀框架，核心思路是打破美联储长期“引导预期”的模式，改革方案预计 2026 年底成型、2027 年落地，未来市场波动率预计将持续抬升。展望未来，美国财政退税的刺激效应或逐步减弱，高利率的紧缩效应或持续显现，基本面压力边际加大，随着美伊冲突和谈进展良好，油价已出现快速回落，三季度通胀或将迎来回落，届时紧缩预期或逐步缓解，若就业市场超预期走弱，市场或重新定价美联储的宽松预期。

固收市场方面，整个二季度，在国内经济基本面走弱、资金面持续宽松的背景下，债券收益率整体下行，幅度约在 10BP 左右。从期限结构来看，债券收益率曲线总体依然较为陡峭，尤其是国债 30-10 利差仍然在较阔水平，主要原因是超长债配置力量仍相对缺位。下阶段，债券收益率能否进一步下行，取决于下半年财政力度能否回升、带动经济企稳。若内需进一步下滑、降息预期出现升温，则债券收益率仍有下行空间；若财政发力，内需企稳，则债券收益率下行空间有限。

固收操作方面，今年一季度随着债市企稳我们适度拉长了久期中枢并增加了杠杆水平，二季度则维持偏长久期，并择机进行波段交易。近期随着资金面持续偏紧，我们适度降低了杠杆水平与持仓久期，向市场中性水平靠拢。下阶段，随着二季度经济快速走弱，下半年财政发力的可能性在提升，有可能会推动经济数据边际回暖。此外，近期资金面持续偏紧，货币政策的不确定性上升。中性预期下，下半年债市或将重回震荡，我们将逐步向市场中性久期水平收敛，同时积极参与长久期利率债波段操作、增厚产品收益。可转债方面，当前估值偏贵且波动较大，将继续保持中低仓位，结构上仍围绕科技主线进行配置。

#### 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 3.01%，业绩比较基准收益率为 0.57%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 2.95%，业绩比较基准收益率为 0.57%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | —              | —            |
|    | 其中：股票             | —              | —            |
| 2  | 基金投资              | —              | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 176,488,709.34 | 93.19        |
|    | 其中：债券             | 176,488,709.34 | 93.19        |
|    | 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      | 1,011,252.15   | 0.53         |
| 8  | 其他资产              | 11,876,194.35  | 6.27         |
| 9  | 合计                | 189,376,155.84 | 100.00       |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 7,045,373.42  | 5.16         |
| 2  | 央行票据      | —             | —            |
| 3  | 金融债券      | 51,106,040.55 | 37.40        |
|    | 其中：政策性金融债 | 20,371,090.41 | 14.91        |
| 4  | 企业债券      | 61,008,209.86 | 44.64        |
| 5  | 企业短期融资券   | —             | —            |
| 6  | 中期票据      | 40,808,675.61 | 29.86        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 16,520,409.90 | 12.09        |
| 8  | 同业存单      | —             | —            |
| 9  | 其他        | —             | —            |

|    |    |                |        |
|----|----|----------------|--------|
| 10 | 合计 | 176,488,709.34 | 129.15 |
|----|----|----------------|--------|

### 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  | 260205    | 26 国开 05           | 200,000 | 20,371,090.41 | 14.91        |
| 2  | 232400032 | 24 成都银行二级资本债 02    | 100,000 | 10,342,400.00 | 7.57         |
| 3  | 102584064 | 25 津城建 MTN009      | 100,000 | 10,297,991.78 | 7.54         |
| 4  | 102583994 | 25 鲁黄金 MTN008(科创债) | 100,000 | 10,284,832.33 | 7.53         |
| 5  | 232580056 | 25 广发银行二级资本债 01BC  | 100,000 | 10,270,643.84 | 7.52         |

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.9.1 本期国债期货投资政策

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

#### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险指标说明      |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|-------------|
| -                 | -  | -        | -       | -         | -           |
| 公允价值变动总额合计（元）     |    |          |         |           | -           |
| 国债期货投资本期收益（元）     |    |          |         |           | -227,092.01 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） |    |          |         |           | 361,500.00  |

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

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

## 5.10 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

国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局地方分局、中国人民银行处罚。

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。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 35,836.85     |
| 2  | 应收证券清算款 | 11,840,357.50 |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | —             |
| 5  | 应收申购款   | —             |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 其他      | —             |
| 8  | 合计      | 11,876,194.35 |

### 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  | 118058 | 微导转债  | 1,543,946.74 | 1.13         |
| 2  | 118051 | 皓元转债  | 1,539,068.07 | 1.13         |
| 3  | 118050 | 航宇转债  | 1,529,035.73 | 1.12         |
| 4  | 123255 | 鼎龙转债  | 1,479,598.10 | 1.08         |
| 5  | 123176 | 精测转 2 | 1,364,685.63 | 1.00         |
| 6  | 128136 | 立讯转债  | 1,291,578.82 | 0.95         |
| 7  | 118061 | 茂莱转债  | 1,263,828.64 | 0.92         |
| 8  | 127037 | 银轮转债  | 1,076,285.30 | 0.79         |

|    |        |       |            |      |
|----|--------|-------|------------|------|
| 9  | 118062 | 天淮转债  | 961,015.78 | 0.70 |
| 10 | 123188 | 水羊转债  | 900,441.17 | 0.66 |
| 11 | 118056 | 路维转债  | 848,227.97 | 0.62 |
| 12 | 118024 | 冠宇转债  | 594,996.58 | 0.44 |
| 13 | 118013 | 道通转债  | 391,919.76 | 0.29 |
| 14 | 123124 | 晶瑞转 2 | 153,021.21 | 0.11 |

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 景顺长城安悦 180 天持有期债券 A | 景顺长城安悦 180 天持有期债券 C |
|---------------------------|---------------------|---------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 234,207,144.83      | 61,419,185.96       |
| 报告期期间基金总申购份额              | 121,124.60          | 433,155.36          |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 135,355,122.18      | 28,644,192.75       |
| 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               | 98,973,147.25       | 33,208,148.57       |

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安悦 180 天持有期债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城安悦 180 天持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城安悦 180 天持有期债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城安悦 180 天持有期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

2026 年 7 月 21 日