

景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金 2026 年中期报告

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

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 26 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
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	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55

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	56
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	56
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.11 本报告期投资基金情况	57
7.12 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	63
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	63
10.9 其他重大事件	73
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	75
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	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 12 备查文件目录	76
12.1 备查文件目录	76
12.2 存放地点	76
12.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金		
基金简称	景顺长城景颐裕利债券		
基金主代码	018736		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2023 年 11 月 16 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		
报告期末基金份 额总额	16,905,181,058.30 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基 金简称	景顺长城景颐裕利债券 A	景顺长城景颐裕利债券 C	景顺长城景颐裕利债券 F
下属分级基金的交 易代码	018736	018737	025372
报告期末下属分级 基金的份额总额	7,523,259,593.20 份	7,410,076,262.63 份	1,971,845,202.47 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	（一）资产配置策略 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。 （二）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。 （三）股票投资策略 本基金通过基金经理的战略性选股思路以及投研部门的支持，筛选出价值优势明显的优质股票构建股票投资组合。在股票投资方面，本基金利用基金管理人股票研究数据库（SRD）对企业内在价值进行深入细致的分析，并进一步挖掘出受益于中国经济发展趋势和投资主题的公司股票进行投资。其中重点考察企业的业务价值、估值水平、管理能力、现金流情况等要素。 （四）国债期货投资策略 本基金可基于谨慎原则，根据风险管理原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主

	要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。 （五）基金投资策略 本基金可投资经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（仅限于基金管理人旗下的股票型基金及应计入权益类资产的混合型基金、全市场的股票型 ETF，不包含 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、货币市场基金和其他投资范围包含基金的基金）。其中上述应计入权益类资产的混合型基金指根据定期报告披露情况，最近连续四个季度季末股票资产占基金资产的比例均在 60%以上的混合型基金。 （六）信用衍生品投资策略 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。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*8%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*2%
风险收益特征	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。 本基金还可能投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	任航
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599
传真		0755-22381339	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		叶才	谷澍

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.igwfm.com

基金中期报告置备地点	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	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)		
数据和指标	景顺长城景颐裕利债券 A	景顺长城景颐裕利债券 C	景顺长城景颐裕利债券 F
本期已实现收益	57,944,779.64	45,890,574.67	11,375,030.05
本期利润	196,550,273.22	171,710,792.20	42,057,933.78
加权平均基金份额本期利润	0.0467	0.0423	0.0482
本期加权平均净值利润率	4.09%	3.75%	4.23%
本期基金份额净值增长率	3.99%	3.78%	3.98%
3.1.2 期末	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
数据和指标			
期末可供分配利润	680,512,837.60	585,291,336.45	177,719,642.94
期末可供分配基金份额利润	0.0905	0.0790	0.0901
期末基金资产净值	8,744,145,920.10	8,518,547,057.26	2,291,235,592.44
期末基金份额净值	1.1622	1.1495	1.1619

3.1.3 累计 期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
基金份额累 计净值增长 率	16.22%	14.95%	5.98%

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

景顺长城景颐裕利债券 A

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
过去三个月	3.51%	0.19%	1.83%	0.13%	1.68%	0.06%
过去六个月	3.99%	0.18%	2.17%	0.12%	1.82%	0.06%
过去一年	8.51%	0.16%	3.32%	0.11%	5.19%	0.05%
自基金合同生效起 至今	16.22%	0.13%	14.73%	0.12%	1.49%	0.01%

景顺长城景颐裕利债券 C

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
过去三个月	3.41%	0.19%	1.83%	0.13%	1.58%	0.06%
过去六个月	3.78%	0.18%	2.17%	0.12%	1.61%	0.06%
过去一年	8.09%	0.16%	3.32%	0.11%	4.77%	0.05%
自基金合同生效起 至今	14.95%	0.13%	14.73%	0.12%	0.22%	0.01%

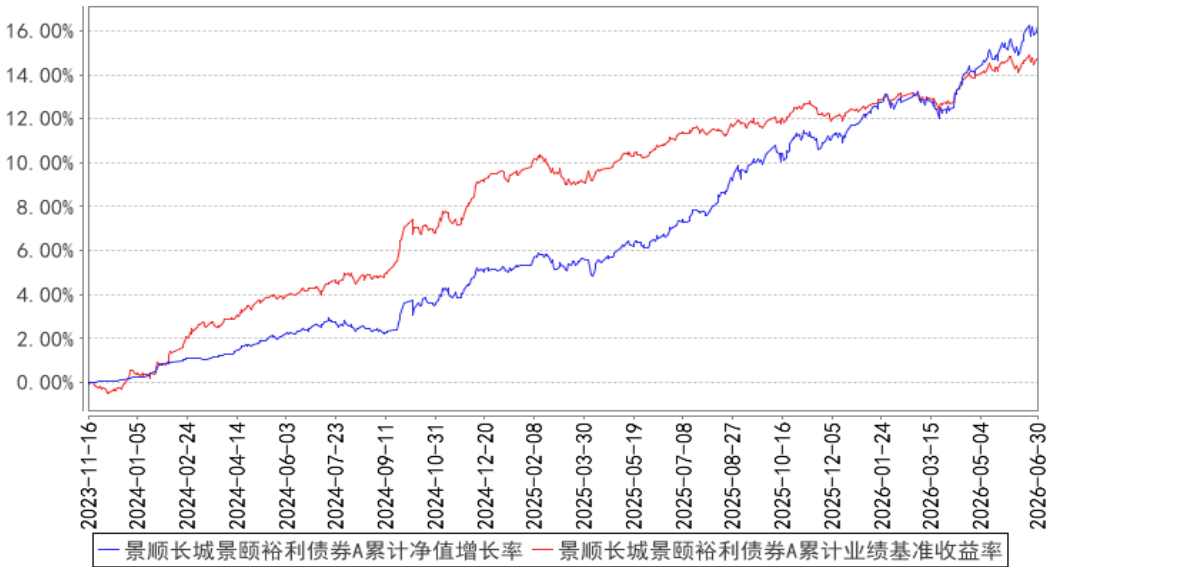
景顺长城景颐裕利债券 F

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
过去三个月	3.51%	0.19%	1.83%	0.13%	1.68%	0.06%
过去六个月	3.98%	0.18%	2.17%	0.12%	1.81%	0.06%
自基金合同生效起至今	5.98%	0.18%	2.67%	0.11%	3.31%	0.07%

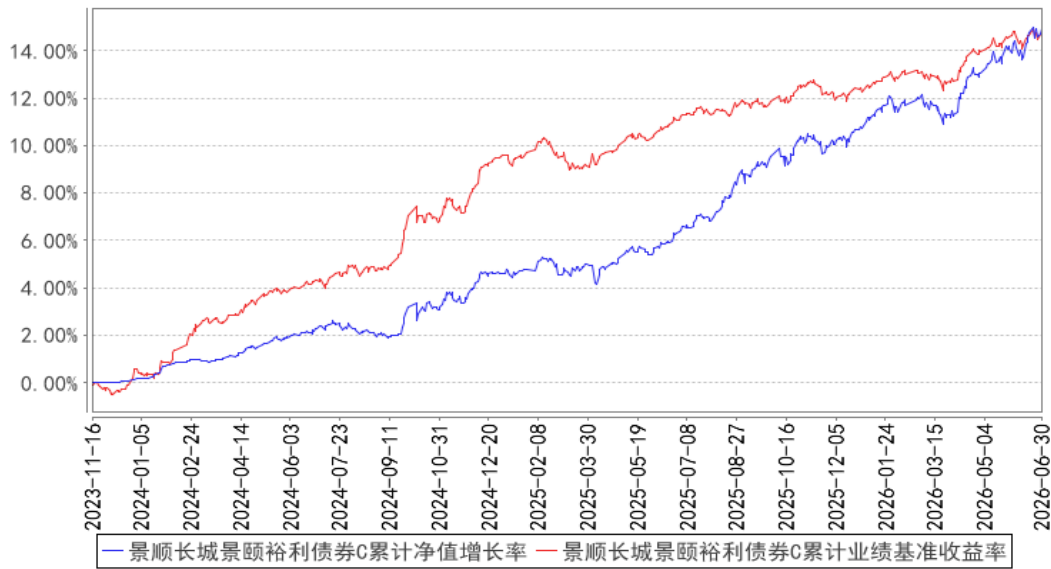
注：本基金于 2025 年 08 月 29 日增设 F 类基金份额，并于 2025 年 09 月 01 日开始对 F 类份额进行估值。

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

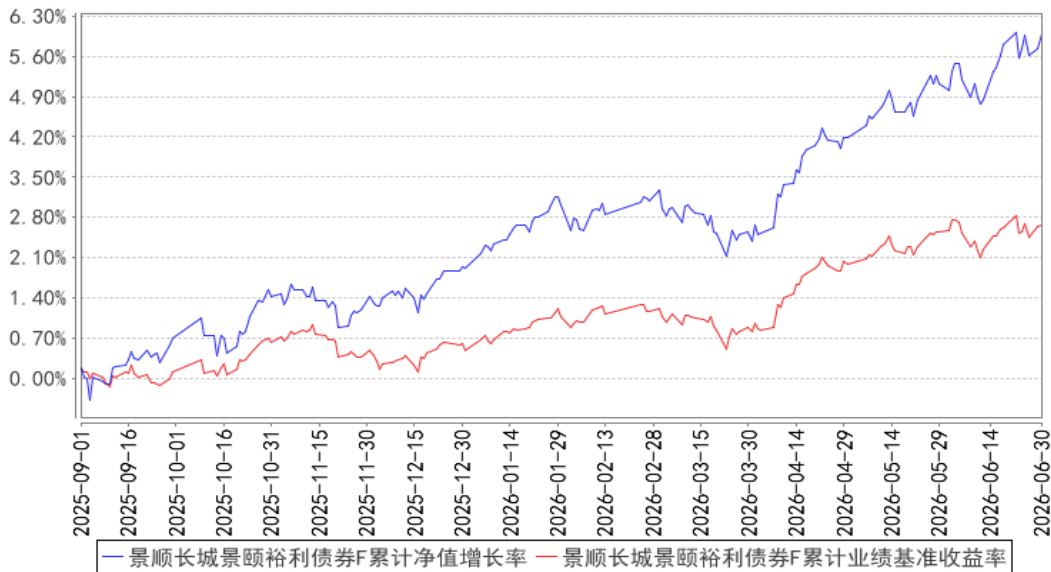
景顺长城景颐裕利债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城景颐裕利债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城景颐裕利债券F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：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于权益类资产、可转换债券（含可分离型可转换债券）及可交换债券比例合计不高于基金资产的 20%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%，本基金投资的权益类资产包括股票、股票型基金以及应计入权益类资产的混合型基金，其中上述应计入权益类资产的混合型基金指根据定期报告披露情况，最近连续四个季度季末股票资产占基金资产的比例均在 60%以上的混合型基金。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金投资比例不超过基金资产净值的 10%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的建仓期为自 2023 年 11 月 16 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。本基金自 2025 年 8 月 29 日起增设 F 类基金份额。

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 2026 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 233 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		
毛 从 容	本基金的基金经理	2023 年 11 月 16 日	-	26 年	经济学硕士。曾任职于交通银行及担任长城证券金融研究所债券业务小组组长。2003 年 3 月加入本公司，担任研究部研究员，自 2005 年 6 月起担任基金经理，现任公司副总经理、固定收益部基金经理。具有 26 年证券、基金行业从业经验。
陈莹	本基金的基金经理	2024 年 3 月 21 日	-	12 年	工学硕士。曾任交通银行公司机构部高级行业经理，浙商基金管理有限公司固定收益部信用评级研究员，华安基金管理有限公司固定收益部信用分析师。2019 年 11 月加入本公司，担任固定收益部信用研究员，自 2020 年 7 月起担任固定收益部基金经理，现任混合资产投资部基金经理。具有 12 年证券、基金行业从业经验。
WANG	本基金的	2024 年	-	14 年	商学学士，CFA，FRM。曾任平安银行国际

A0	基金经理	11 月 1 日			业务部跨境人民币与汇率产品推广岗，平安基金管理有限公司固定收益投资中心固定收益研究员、基金经理，汇华理财有限公司投资部多资产高级经理。2023 年 12 月加入本公司，自 2024 年 1 月起担任固定收益部总监、基金经理。具有 14 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。

4.1.3 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、《景顺长城景颐裕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 10 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 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

今年上半年，国内经济延续外需强、内需弱的格局。一季度经济实现开门红之后，二季度经济呈现下滑的局面：上半年 GDP 同比增长 4.7%，其中一季度 5.0%，二季度回落至 4.3%。价格层面，二季度 GDP 平减指数同比上涨 1.4%，但油价走势高度不确定，后续价格判断仍面临较大扰动。消费端，4 月社零同比仅增 0.2%，5 月进一步跌至-0.6%，6 月内需边际企稳但整体偏弱，社零在基数走低支撑下同比转正至 1%，“以旧换新”品类明显修复，更广泛的居民服务消费韧性尚可，二季度居民消费支出从 3.6%回升至 3.8%。投资当月同比下滑 10%，制造业投资跌幅收敛至-3.2%，基建下滑 10.2%，地产下滑 24.4%。一线城市二手房价连续 4 个月环比上涨 0.3%以上，但未能向二三线城市及一手房扩散。出口方面，6 月美元计价出口同比升至 27%，AI 景气、关税扰动消退及供应链优势仍是核心驱动，叠加美伊和谈带动油价回落，出口品类广谱改善，生产端随之修复，工业增加值回升至 5.3%。值得注意的是生产强于需求，二季度产能利用率进一步下行，距离历史低位很近，价格内生回升动能不足。一季度经济开局向好，二季度有所走弱，主因财政支出力度边际放缓。海外方面，6 月 FOMC 维持利率不变但释放强烈鹰派信号，SEP 大幅上调 PCE 通胀预测至 3.6%，点阵图显示年内加息预期升温，年底利率中值上修至 3.75%。沃什宣布成立五大改革工作组，未来市场波动率预计持续抬升。经济数据方面，美国 6 月非农新增仅 5.7 万人，大幅低于预期，前两月下修 7.4 万人；CPI 环比-0.4%、核心 CPI 环比-0.02%，均超预期走弱，缓解了市场对加息的担忧。

市场表现方面，上半年权益市场震荡上行，同时结构分化十分极致。全球经济的主要增量来源还是 AI 投资，应用方面 AI coding 领域的快速商业化使得投资者看到了 AI 投资正循环的曙光。随着 AI 投资规模快速提升，对传统电子通讯产业链的各个制造环节的需求都形成拉动从而带动相关个股上涨。一季度的美伊冲突使得新能源中的储能以及传统能源板块有阶段性超额收益。代表国内传统经济复苏方向的消费和地产链继续低位震荡。

债券市场方面，上半年债券收益率总体震荡下行。一季度，5 年期国债下行 9BP 至 1.54%，10 年期国债下行 3BP 至 1.82%，30 年国债上行 8BP，曲线更陡峭化。二季度债市表现整体较好，4 月中东局势缓和带动油价回落，输入型通胀预期降温，叠加资金面持续超季节性宽松及理财规模回升带来的旺盛配置需求，长端强于短端。5 月收益率延续下行，信用利差与期限利差进一步压缩，10 年和 30 年国债下行至 1.70%和 2.20%的关键点位。6 月受资金面收紧与央行持续回笼的影响，债券收益率先上后下，但整体小幅上行，长债、超长债收益率反弹明显。二季度 1 年/3 年/5 年/10 年/30 年国债收益分别下行 10/2/10/8/12BP。

操作方面，权益部分，1-2 月仓位较高，3 月由于担心中东局势升级有所减仓，4 月初在美伊释放和谈信号之后加仓，并在 5 月初上证指数上涨到 4200 点附近时，逐步减仓至中性略偏低的仓位水平。债券部分，动态调整产品久期与杠杆水平，主要配置中高等级信用债，也择机参与了中长利率债的交易性机会。

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 3.99%，业绩比较基准收益率为 2.17%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 3.78%，业绩比较基准收益率为 2.17%。

本报告期内，本基金 F 类份额净值增长率为 3.98%，业绩比较基准收益率为 2.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，出口韧性大概率持续，面对二季度内需加速下滑，三季度政策调整的可能性较大，有望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，这将带动基建投资提速，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，国际局势仍动荡，联储的货币政策走势仍具备较高的不确定性，仍需保持密切跟踪。

权益市场方面，我们认为 A 股市场主要问题是极致的结构分化，当然这种分化也是在反映全球经济主要增量依靠 AI 投资的现实状况。我们依旧看好权益市场结构性机会，将持续关注组合个股的估值和景气度的匹配情况，动态调整优化持仓结构。

债券市场方面，货币市场有望保持宽松的基调，中短久期票息资产的收益稳定性较强，长端利率仍需关注政策利率的边际变化，而 2026 年下半年银行负债成本整体有望持续下降。策略方面，组合以中短端高等级信用作为底仓，并根据基本面、资金面及政策面的预期参与利率交易，优化组合结构。

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。基金估值委员会的成员包括投资部、研究部/固定收益部信评人员、基金事务部、法律监察稽核部、风险管理部等相关人员。本基金托管人根据基金合同及法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 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：景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	9,820,818.44	9,269,635.87

结算备付金		18,983,430.20	6,970,968.46
存出保证金		691,413.42	249,592.89
交易性金融资产	6.4.7.2	20,211,422,055.41	4,317,740,591.43
其中：股票投资		1,375,638,128.49	332,141,127.08
基金投资		408,991,830.31	25,277,289.24
债券投资		18,426,792,096.61	3,960,322,175.11
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	150,000,000.00	197,909,959.04
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		25,886,564.76	2,446,350.95
应收股利		483,893.19	4,029.16
应收申购款		280,616,867.12	142,818,852.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		20,697,905,042.54	4,677,409,979.98
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025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		820,161,636.34	400,107,978.26
应付清算款		537,603.35	1,297,024.66
应付赎回款		307,524,748.77	67,696,910.17
应付管理人报酬		9,896,963.87	2,149,898.73
应付托管费		2,118,924.29	460,683.47
应付销售服务费		2,481,329.68	632,822.64
应付投资顾问费		-	-
应交税费		584,030.92	215,176.50
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	671,235.52	319,872.48
负债合计		1,143,976,472.74	472,880,366.91
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	16,905,181,058.30	3,777,027,978.56
其他综合收益	6.4.7.11	-	-

未分配利润	6.4.7.12	2,648,747,511.50	427,501,634.51
净资产合计		19,553,928,569.80	4,204,529,613.07
负债和净资产总计		20,697,905,042.54	4,677,409,979.98

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 16,905,181,058.30 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.1622 元，基金份额 7,523,259,593.20 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.1495 元，基金份额 7,410,076,262.63 份；本基金 F 类份额净值人民币 1.1619 元，基金份额 1,971,845,202.47 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		465,704,011.07	5,512,055.56
1. 利息收入		1,444,719.71	54,134.08
其中：存款利息收入	6.4.7.13	68,048.89	13,600.17
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		1,376,670.82	40,533.91
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		167,384,556.18	4,656,065.62
其中：股票投资收益	6.4.7.14	26,145,837.74	310,955.83
基金投资收益	6.4.7.15	-359,446.25	189,510.41
债券投资收益	6.4.7.16	133,595,192.74	3,873,631.47
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	8,002,971.95	281,967.91
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）	6.4.7.21	295,108,614.84	759,499.23
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. 22	1, 766, 120. 34	42, 356. 63
减：二、营业总支出		55, 385, 011. 87	1, 440, 392. 45
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	35, 660, 494. 72	821, 099. 11
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	7, 638, 068. 23	175, 928. 48
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	9, 055, 190. 73	131, 578. 85
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2, 722, 555. 78	192, 164. 98
其中：卖出回购金融资产支出		2, 722, 555. 78	192, 164. 98
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 24	-	-
7. 税金及附加		178, 450. 97	7, 823. 78
8. 其他费用	6. 4. 7. 25	130, 251. 44	111, 797. 25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		410, 318, 999. 20	4, 071, 663. 11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		410, 318, 999. 20	4, 071, 663. 11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		410, 318, 999. 20	4, 071, 663. 11

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	3, 777, 027, 978. 56	-	427, 501, 634. 51	4, 204, 529, 613. 07
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3, 777, 027, 978. 56	-	427, 501, 634. 51	4, 204, 529, 613. 07
三、本期增减变动额（减少以“-”	13, 128, 153, 079	-	2, 221, 245, 876.	15, 349, 398, 956.

号填列)	. 74		99	73
(一)、综合收益总额	-	-	410,318,999.20	410,318,999.20
(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)	13,128,153,079 . 74	-	1,810,926,877. 79	14,939,079,957. 53
其中：1. 基金申购款	19,714,007,603 . 84	-	2,682,782,646. 31	22,396,790,250. 15
2. 基金赎回款	-6,585,854,524 . 10	-	-871,855,768.5 2	-7,457,710,292. 62
(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	16,905,181,058 . 30	-	2,648,747,511. 50	19,553,928,569. 80
项目	上年度可比期间 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	308,027,515.81	-	15,659,836.04	323,687,351.85
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	308,027,515.81	-	15,659,836.04	323,687,351.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-96,864,550.49	-	-1,457,720.66	-98,322,271.15
(一)、综合收益总额	-	-	4,071,663.11	4,071,663.11

(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)	-96,864,550.49	-	-5,529,383.77	-102,393,934.26
其中：1. 基金申购款	159,252,611.34	-	8,978,293.26	168,230,904.60
2. 基金赎回款	-256,117,161.83	-	-14,507,677.03	-270,624,838.86
(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	211,162,965.32	-	14,202,115.38	225,365,080.70

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：

康乐

吴建军

邵媛媛

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

景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]1239 号文《关于准予景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金注册的批复》，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《景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2023 年 11 月 16 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 2,985,109,045.58 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 504,197.73 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 2,985,613,243.31 元，折合 2,985,613,243.31 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，登记机构为本基金管理人，基

金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金初始基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额，自 2025 年 8 月 29 日起增设 F 类基金份额。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、公开发行的次级债、可转换债券（含可分离型可转换债券）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股票（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、国债期货、经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（仅限于基金管理人旗下的股票型基金及应计入权益类资产的混合型基金、全市场的股票型 ETF，不包含 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、货币市场基金和其他投资范围包含基金的基金）、信用衍生品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（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金的投资组合比例为：本基金债券资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于权益类资产、可转换债券（含可分离型可转换债券）及可交换债券比例合计不高于基金资产的 20%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%，本基金投资的权益类资产包括股票、股票型基金以及应计入权益类资产的混合型基金，其中上述应计入权益类资产的混合型基金指根据定期报告披露情况，最近连续四个季度季末股票资产占基金资产的比例均在 60%以上的混合型基金。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金投资比例不超过基金资产净值的 10%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本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 2026 年 8 月 26 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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 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

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（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、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包

含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分) 的利息收入, 继续免征增值税直至债券到期。

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《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局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《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《财政部 国家税务总局 证监会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, 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《财政部 国家税务总局 证监会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, 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

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《财政部 国家税务总局 证监会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《财政部 国家税务总局 证监会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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	9,820,818.44
等于：本金	9,820,210.79
加：应计利息	607.65
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	9,820,818.44

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,142,917,836.97	-	1,375,638,128.49	232,720,291.52
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,497,873,676.06	16,752,725.96	7,521,406,850.26	6,780,448.24
	银行间市场	10,805,262,229.53	56,051,896.35	10,905,385,246.35	44,071,120.47
	合计	18,303,135,905.59	72,804,622.31	18,426,792,096.61	50,851,568.71

资产支持证券	-	-	-	-
基金	363,690,610.65	-	408,991,830.31	45,301,219.66
其他	-	-	-	-
合计	19,809,744,353.21	72,804,622.31	20,211,422,055.41	328,873,079.89

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 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	150,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	150,000,000.00	-

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

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末的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

本基金本报告期末的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

本基金本报告期末的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

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	95,138.24
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	480,016.83
其中：交易所市场	343,005.06
银行间市场	137,011.77
应付利息	-
预提费用	96,080.45
合计	671,235.52

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城景颐裕利债券 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,149,800,813.13	1,149,800,813.13
本期申购	8,163,863,275.98	8,163,863,275.98
本期赎回（以“-”号填列）	-1,790,404,495.91	-1,790,404,495.91
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	7,523,259,593.20	7,523,259,593.20

景顺长城景颐裕利债券 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,670,123,514.50	1,670,123,514.50
本期申购	9,482,256,246.35	9,482,256,246.35
本期赎回（以“-”号填列）	-3,742,303,498.22	-3,742,303,498.22
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	7,410,076,262.63	7,410,076,262.63

景顺长城景颐裕利债券 F

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	957,103,650.93	957,103,650.93
本期申购	2,067,888,081.51	2,067,888,081.51
本期赎回（以“-”号填列）	-1,053,146,529.97	-1,053,146,529.97
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	1,971,845,202.47	1,971,845,202.47

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

景顺长城景颐裕利债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	88,589,975.93	46,740,087.64	135,330,063.57
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	88,589,975.93	46,740,087.64	135,330,063.57
本期利润	57,944,779.64	138,605,493.58	196,550,273.22
本期基金份额交易产生的变动数	533,978,082.03	355,027,908.08	889,005,990.11
其中：基金申购款	686,322,517.49	454,467,769.99	1,140,790,287.48
基金赎回款	-152,344,435.46	-99,439,861.91	-251,784,297.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	680,512,837.60	540,373,489.30	1,220,886,326.90

景顺长城景颐裕利债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	113,429,771.55	66,372,032.08	179,801,803.63
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	113,429,771.55	66,372,032.08	179,801,803.63
本期利润	45,890,574.67	125,820,217.53	171,710,792.20
本期基金份额交易产生的变动数	425,970,990.23	330,987,208.57	756,958,198.80
其中：基金申购款	703,459,688.06	533,661,002.23	1,237,120,690.29
基金赎回款	-277,488,697.83	-202,673,793.66	-480,162,491.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	585,291,336.45	523,179,458.18	1,108,470,794.63

景顺长城景颐裕利债券 F

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	73,443,405.35	38,926,361.96	112,369,767.31
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	73,443,405.35	38,926,361.96	112,369,767.31
本期利润	11,375,030.05	30,682,903.73	42,057,933.78
本期基金份额交易产生的变动数	92,901,207.54	72,061,481.34	164,962,688.88
其中：基金申购款	178,888,324.93	125,983,343.61	304,871,668.54
基金赎回款	-85,987,117.39	-53,921,862.27	-139,908,979.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	177,719,642.94	141,670,747.03	319,390,389.97

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	38,899.52
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	20,136.11
其他	9,013.26
合计	68,048.89

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 2026年1月1日至2026年6月30日
----	----------------------------

股票投资收益——买卖股票差价收入	26,145,837.74
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	26,145,837.74

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	301,014,716.16
减：卖出股票成本总额	273,843,499.47
减：交易费用	1,025,378.95
买卖股票差价收入	26,145,837.74

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	44,168,803.43
减：卖出/赎回基金成本总额	44,510,287.63
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	826.91
减：交易费用	17,135.14
基金投资收益	-359,446.25

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	97,381,524.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	36,213,667.87
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	133,595,192.74

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	23,362,075,081.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	23,179,633,639.75
减：应计利息总额	146,005,440.30
减：交易费用	222,333.46
买卖债券差价收入	36,213,667.87

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,115,060.04
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	887,911.91
合计	8,002,971.95

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
------	---------------------------------------

1. 交易性金融资产	295,108,614.84
股票投资	195,822,002.99
债券投资	54,974,205.98
资产支持证券投资	—
基金投资	44,312,405.87
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	295,108,614.84

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,689,870.41
基金转换费收入	76,249.93
合计	1,766,120.34

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	—
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	223,354.13
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	65,234.95

注：上述费用按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法估算得出，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.24 信用减值损失

无。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
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	21,746.29

证券组合费	3,093.49
存托服务费	31.21
合计	130,251.44

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、关联关系

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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

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股票交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	35,660,494.72	821,099.11
其中：应支付销售机构的客户维护费	16,405,691.91	407,622.90

应支付基金管理人的净管理费	19,254,802.81	413,476.21
---------------	---------------	------------

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费，支付销售机构的客户维护费不因投资于基金管理人所管理的公开募集证券投资基金而调减，因此应支付基金管理人的净管理费可能为负。支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的 0.70%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额×0.70%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,638,068.23	175,928.48

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的 0.15%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：

日托管费=前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额×0.15%/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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	景顺长城景颐裕利债券 A	景顺长城景颐裕利债券 C	景顺长城景颐裕利债券 F	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	3,873.77	4,819.09	8,692.86
中国农业银行	-	350,490.17	-	350,490.17
长城证券	-	-	-	-
合计	-	354,363.94	4,819.09	359,183.03
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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			
	景顺长城景颐裕利债券 A	景顺长城景颐裕利债券 C	景顺长城景颐裕利债券 F	合计
景顺长城基金管理	-	-	-	-

有限公司				
中国农业银行	-	49,814.60	-	49,814.60
长城证券	-	-	-	-
合计	-	49,814.60	-	49,814.60

注：1、支付基金销售机构的基金份额销售服务费按前一日对应类别基金资产净值的约定年费率计提，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。C类和F类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.40%和0.01%。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费}=\text{前一日对应类别基金资产净值}\times\text{对应类别约定年费率}/\text{当年天数}。$$

2、自2025年8月29日起，本基金在现有基金份额的基础上增设F类基金份额，原A类基金份额和C类基金份额保持不变。

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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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
中国农业银行－活期	9,820,818.44	38,899.52	890,139.90	9,678.97

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或约定利率计息。

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有基金管理人景顺长城基金管理有限公司所管理的公开募集证券投资基金（于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有基金管理人景顺长城基金管理有限公司所管理的公开募集证券投资基金合计人民币 801,801.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.02%）。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	0.80
当期交易基金产生的赎回费（元）	33.11	52.48
当期持有基金产生的应支付销售 服务费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付管理 费（元）	992.00	1,609.45
当期持有基金产生的应支付托管 费（元）	198.40	321.89

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

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

3、根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用。其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

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（2026 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113704	春风转债	2026 年 6 月 11 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	1,380	138,000.00	138,006.35	-
118070	南芯转债	2026 年 6 月 22 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	520	52,000.00	52,002.96	-
118072	鼎通转债	2026 年 6 月 25 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.09	-
524881	26 克投 02	2026 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	700,000	70,000,000.00	69,999,290.41	-

注：以上限售证券的实际流通日期以上市公司的公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	7,953	3,936,636.05	6,616,896.00	-

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 2026 年 06 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 320,013,006.18 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
102680672	26 沪国投 MTN001 (混合型科创债)	2026 年 7 月 7 日	101.24	1,564,000	158,337,774.57
232480007	24 建行二级资本债 01B	2026 年 7 月 7 日	106.59	1,750,000	186,536,700.00
332580006	25 建行科创债 01A(BC)	2026 年 7 月 7 日	100.48	55,000	5,526,410.55
合计				3,369,000	350,400,885.12

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 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 500,148,630.16 元，于 2026 年 07 月 07 日到期。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 86.02%（上年度末：82.11%）。

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组合持仓集中度指标、流通受限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，并按照合约规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 2026 年 6 月 30	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
----------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

日							
资产							
货币资金	9,820,818.44	-	-	-	-	-	9,820,818.44
结算备付金	18,983,430.20	-	-	-	-	-	18,983,430.20
存出保证金	691,413.42	-	-	-	-	-	691,413.42
交易性金融资产	148,315,475.28	58,690,167.12	2,203,801,787.07	11,892,189,329.37	4,123,795,337.77	1,784,629,958.80	20,211,422,055.41
买入返售金融资产	150,000,000.00	-	-	-	-	-	150,000,000.00
应收股利	-	-	-	-	-	483,893.19	483,893.19
应收申购款	-	-	-	-	-	280,616,867.12	280,616,867.12
应收清算款	-	-	-	-	-	25,886,564.76	25,886,564.76
资产总计	327,811,137.34	58,690,167.12	2,203,801,787.07	11,892,189,329.37	4,123,795,337.77	2,091,617,283.87	20,697,905,042.54
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	307,524,748.77	307,524,748.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,896,963.87	9,896,963.87
应付托管费	-	-	-	-	-	2,118,924.29	2,118,924.29
应付清算款	-	-	-	-	-	537,603.35	537,603.35
卖出回购金融资产款	820,161,636.34	-	-	-	-	-	820,161,636.34
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,481,329.68	2,481,329.68
应交税费	-	-	-	-	-	584,030.92	584,030.92
其他负债	-	-	-	-	-	671,235.52	671,235.52
负债总计	820,161,636.34	-	-	-	-	323,814,836.40	1,143,976,472.74
利率敏感度缺口	-492,350,499.00	58,690,167.12	2,203,801,787.07	11,892,189,329.37	4,123,795,337.77	-	-
上年度末							
2025 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	9,269,635.87	-	-	-	-	-	9,269,635.87
结算备付金	6,970,968.46	-	-	-	-	-	6,970,968.46
存出保证金	249,592.89	-	-	-	-	-	249,592.89
交易性金融资产	30,334,652.06	30,179,921.10	481,567,587.21	2,537,532,587.89	880,707,426.85	357,418,416.32	4,317,740,591.43

买入返售金融资产	197,909,959.04	-	-	-	-	-	197,909,959.04
应收股利	-	-	-	-	-	4,029.16	4,029.16
应收申购款	-	-	-	-	-	142,818,852.18	142,818,852.18
应收清算款	-	-	-	-	-	2,446,350.95	2,446,350.95
资产总计	244,734,808.32	30,179,921.10	481,567,587.21	2,537,532,587.89	880,707,426.85	502,687,648.61	4,677,409,979.98
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	67,696,910.17	67,696,910.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,149,898.73	2,149,898.73
应付托管费	-	-	-	-	-	460,683.47	460,683.47
应付清算款	-	-	-	-	-	1,297,024.66	1,297,024.66
卖出回购金融资产款	400,107,978.26	-	-	-	-	-	400,107,978.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-	632,822.64	632,822.64
应交税费	-	-	-	-	-	215,176.50	215,176.50
其他负债	-	-	-	-	-	319,872.48	319,872.48
负债总计	400,107,978.26	-	-	-	-	72,772,388.65	472,880,366.91
利率敏感度缺口	-155,373,169.94	30,179,921.10	481,567,587.21	2,537,532,587.89	880,707,426.85	-	-

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-174,921,269.12	-30,841,998.75
	市场利率下降 25 个基点	177,562,878.64	31,301,450.78

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

金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	123,636,742.19	-	123,636,742.19
资产合计	-	123,636,742.19	-	123,636,742.19
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	123,636,742.19	-	123,636,742.19
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	35,179,100.65	-	35,179,100.65
资产合计	-	35,179,100.65	-	35,179,100.65
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	35,179,100.65	-	35,179,100.65

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	6,181,837.11	1,758,955.03
	所有外币相对人民币贬值 5%	-6,181,837.11	-1,758,955.03

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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	1,375,638,128.49	7.04	332,141,127.08	7.90
交易性金融资产—基金投资	408,991,830.31	2.09	25,277,289.24	0.60
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	1,784,629,958.80	9.13	357,418,416.32	8.50

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）

	沪深 300 指数上升 5%	134, 108, 630. 91	35, 397, 868. 91
	沪深 300 指数下降 5%	-134, 108, 630. 91	-35, 397, 868. 91

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1, 778, 013, 062. 80	357, 013, 207. 04
第二层次	18, 433, 408, 992. 61	3, 960, 727, 384. 39
第三层次	-	-
合计	20, 211, 422, 055. 41	4, 317, 740, 591. 43

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、非公开发行等情况，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	1,375,638,128.49	6.65
	其中：股票	1,375,638,128.49	6.65
2	基金投资	408,991,830.31	1.98
3	固定收益投资	18,426,792,096.61	89.03
	其中：债券	18,426,792,096.61	89.03
	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	150,000,000.00	0.72
	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	28,804,248.64	0.14
8	其他各项资产	307,678,738.49	1.49
9	合计	20,697,905,042.54	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 123,636,742.19 元，占基金资产净值的比例为 0.63%。

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	1,120,000.00	0.01
B	采矿业	190,392,059.10	0.97
C	制造业	959,405,761.84	4.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,074,000.00	0.01
F	批发和零售业	572,253.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	2,452,098.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,257,647.16	0.31
J	金融业	28,705,806.00	0.15

K	房地产业	2,370,345.00	0.01
L	租赁和商务服务业	1,785,476.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	1,880,343.20	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	985,597.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,252,001,386.30	6.40

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
材料	18,144,733.01	0.09
必需消费品	1,850,781.03	0.01
非必需消费品	13,599,725.50	0.07
能源	4,533,658.68	0.02
金融	3,869,237.39	0.02
政府	—	—
工业	983,858.69	0.01
医疗保健	189,430.76	0.00
房地产	—	—
科技	59,967,919.28	0.31
公用事业	—	—
通讯	20,497,397.85	0.10
合计	123,636,742.19	0.63

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

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	300308	中际旭创	111,700	141,859,000.00	0.73
2	601899	紫金矿业	5,413,300	136,090,362.00	0.70
3	300502	新易盛	190,152	115,422,264.00	0.59
4	688256	寒武纪	28,355	45,241,820.25	0.23
5	002384	东山精密	152,000	39,877,200.00	0.20
6	00981	中芯国际	486,000	37,737,107.82	0.19
7	603986	兆易创新	40,200	32,763,000.00	0.17
8	300223	北京君正	92,500	23,023,250.00	0.12
9	002463	沪电股份	137,000	20,933,600.00	0.11
10	601138	工业富联	289,100	20,858,565.00	0.11
11	688041	海光信息	53,311	19,741,063.30	0.10
12	002436	兴森科技	363,400	18,515,230.00	0.09

13	600183	生益科技	106,400	18,449,760.00	0.09
14	002916	深南电路	40,000	18,316,000.00	0.09
15	00700	腾讯控股	48,400	18,067,855.04	0.09
16	300750	宁德时代	44,900	17,646,149.00	0.09
17	601168	西部矿业	513,600	13,939,104.00	0.07
18	688548	广钢气体	267,433	13,933,259.30	0.07
19	01347	华虹宏力	73,498	13,737,655.24	0.07
20	002475	立讯精密	187,400	13,192,960.00	0.07
21	09988	阿里巴巴-W	159,700	12,878,985.34	0.07
22	002080	中材科技	107,500	9,675,000.00	0.05
23	688008	澜起科技	29,864	9,254,853.60	0.05
24	688778	厦钨新能	162,361	8,832,438.40	0.05
25	300757	罗博特科	13,800	8,542,200.00	0.04
26	002008	大族激光	55,200	8,286,072.00	0.04
27	002371	北方华创	9,000	7,961,040.00	0.04
28	300870	欧陆通	22,660	7,833,335.40	0.04
29	300274	阳光电源	48,800	7,760,176.00	0.04
30	603078	江化微	150,300	7,427,826.00	0.04
31	000933	神火股份	341,300	7,235,560.00	0.04
32	002552	宝鼎科技	113,100	6,899,100.00	0.04
33	600036	招商银行	192,600	6,837,300.00	0.03
34	688072	拓荆科技	7,953	6,616,896.00	0.03
35	601918	新集能源	764,900	6,570,491.00	0.03
36	000962	东方钽业	71,000	6,432,600.00	0.03
37	600499	科达制造	457,300	6,310,740.00	0.03
38	688518	联赢激光	201,051	6,212,475.90	0.03
39	600176	中国巨石	84,700	6,172,936.00	0.03
40	688521	芯原股份	16,090	5,971,642.60	0.03
41	000830	鲁西化工	493,100	5,917,200.00	0.03
42	688012	中微公司	12,184	5,708,204.00	0.03
43	603993	洛阳钼业	285,800	5,015,790.00	0.03
43	03993	洛阳钼业	51,000	672,414.04	0.00
44	00883	中国海洋石油	256,880	4,533,658.68	0.02
44	600938	中国海油	40,300	1,094,145.00	0.01
45	301018	申菱环境	48,120	5,563,153.20	0.03
46	002138	顺络电子	73,600	5,380,160.00	0.03
47	600999	招商证券	253,500	5,348,850.00	0.03
48	300285	国瓷材料	51,700	5,334,406.00	0.03
49	01898	中煤能源	388,000	3,319,424.39	0.02
49	601898	中煤能源	143,900	1,752,702.00	0.01
50	002938	鹏鼎控股	47,900	5,047,702.00	0.03
51	002738	中矿资源	85,400	5,037,746.00	0.03
52	601636	旗滨集团	490,800	5,020,884.00	0.03

53	688019	安集科技	14,769	5,013,484.74	0.03
54	600519	贵州茅台	4,200	4,979,058.00	0.03
55	603766	隆鑫通用	414,700	4,947,371.00	0.03
56	00522	ASMPT	23,800	4,936,351.81	0.03
57	601211	国泰海通	249,500	4,540,900.00	0.02
58	601689	拓普集团	77,400	4,366,908.00	0.02
59	688676	金盘科技	51,187	4,332,467.68	0.02
60	688205	德科立	20,550	4,278,304.50	0.02
61	688766	普冉股份	5,561	4,263,062.60	0.02
62	002493	荣盛石化	391,900	4,212,925.00	0.02
63	688403	汇成股份	105,963	4,206,731.10	0.02
64	00868	信义玻璃	565,000	4,185,933.30	0.02
65	300567	精测电子	12,600	4,001,760.00	0.02
66	000983	山西焦煤	634,900	3,682,420.00	0.02
67	603228	景旺电子	50,300	3,642,223.00	0.02
68	600330	天通股份	117,600	3,626,784.00	0.02
69	301511	德福科技	25,200	3,625,020.00	0.02
70	000725	京东方 A	411,100	3,568,348.00	0.02
71	002536	飞龙股份	73,700	3,477,166.00	0.02
72	002353	杰瑞股份	22,600	3,446,500.00	0.02
73	002273	水晶光电	94,700	3,359,956.00	0.02
74	601088	中国神华	43,500	1,698,240.00	0.01
74	01088	中国神华	44,000	1,533,233.94	0.01
75	688234	天岳先进	18,167	3,152,156.17	0.02
76	002179	中航光电	67,600	3,123,120.00	0.02
77	000657	中钨高新	32,100	3,072,612.00	0.02
78	601958	金钼股份	108,200	3,041,502.00	0.02
79	688702	盛科通信	7,639	2,979,133.61	0.02
80	600961	株冶集团	88,100	2,853,559.00	0.01
81	600732	爱旭股份	204,200	2,828,170.00	0.01
82	002532	天山铝业	262,400	2,815,552.00	0.01
83	000792	盐湖股份	93,000	2,807,670.00	0.01
84	688123	聚辰股份	13,060	2,776,556.00	0.01
85	01258	中国有色矿业	281,000	2,745,703.69	0.01
86	600988	赤峰黄金	103,200	2,716,224.00	0.01
87	603129	春风动力	10,600	2,711,480.00	0.01
88	688167	炬光科技	7,644	2,707,581.24	0.01
89	002126	银轮股份	54,200	2,699,160.00	0.01
90	002409	雅克科技	11,900	2,671,550.00	0.01
91	300548	长芯博创	9,500	2,641,000.00	0.01
92	688112	鼎阳科技	35,627	2,617,159.42	0.01
93	06869	长飞光纤光缆	11,731	2,602,260.40	0.01
94	300083	创世纪	188,300	2,564,646.00	0.01

95	01171	兖矿能源	262,000	2,514,539.11	0.01
96	600487	亨通光电	22,900	2,503,886.00	0.01
97	603179	新泉股份	50,280	2,496,402.00	0.01
98	301150	中一科技	38,800	2,448,668.00	0.01
99	301662	宏工科技	23,345	2,365,315.40	0.01
100	301345	涛涛车业	10,000	2,310,000.00	0.01
101	300033	同花顺	9,500	2,289,500.00	0.01
102	002539	云图控股	201,100	2,276,452.00	0.01
103	00941	中国移动	22,000	1,455,081.82	0.01
103	600941	中国移动	9,100	783,783.00	0.00
104	301205	联特科技	6,700	2,238,470.00	0.01
105	002428	云南锗业	18,300	2,199,294.00	0.01
106	600489	中金黄金	118,600	2,140,730.00	0.01
107	300059	东方财富	104,200	2,123,596.00	0.01
108	600486	扬农化工	41,800	2,119,260.00	0.01
109	600522	中天科技	34,800	2,111,664.00	0.01
110	688146	中船特气	6,006	2,102,039.94	0.01
111	000426	兴业银锡	63,600	2,096,256.00	0.01
112	601666	平煤股份	290,800	2,079,220.00	0.01
113	002989	中天精装	61,000	2,074,000.00	0.01
114	002937	兴瑞科技	46,700	2,051,531.00	0.01
115	002837	英维克	25,530	2,031,166.80	0.01
116	001389	广合科技	8,500	2,016,625.00	0.01
117	02328	中国财险	162,000	2,014,897.03	0.01
118	688195	腾景科技	10,261	1,976,063.38	0.01
119	000923	河钢资源	159,000	1,973,190.00	0.01
120	002851	麦格米特	11,600	1,939,288.00	0.01
121	688099	晶晨股份	18,830	1,937,607.00	0.01
122	603799	华友钴业	39,500	1,906,270.00	0.01
123	301217	铜冠铜箔	11,500	1,898,305.00	0.01
124	002142	宁波银行	63,800	1,894,222.00	0.01
125	688596	正帆科技	23,473	1,855,775.38	0.01
126	600030	中信证券	64,100	1,841,593.00	0.01
127	600031	三一重工	106,500	1,840,320.00	0.01
128	688290	景业智能	27,240	1,807,646.40	0.01
129	000807	云铝股份	81,200	1,797,768.00	0.01
130	002975	博杰股份	12,600	1,789,200.00	0.01
131	002027	分众传媒	368,900	1,785,476.00	0.01
132	002478	常宝股份	282,900	1,748,322.00	0.01
133	000338	潍柴动力	63,200	1,722,200.00	0.01
134	601688	华泰证券	44,200	911,404.00	0.00
134	06886	HTSC	55,000	797,763.18	0.00
135	601012	隆基绿能	130,000	1,705,600.00	0.01

136	002379	宏桥控股	115,200	1,701,504.00	0.01
137	002352	顺丰控股	53,900	1,684,914.00	0.01
138	603920	世运电路	34,900	1,676,596.00	0.01
139	688472	阿特斯	148,408	1,605,774.56	0.01
140	300604	长川科技	4,700	1,604,674.00	0.01
141	688375	国博电子	15,371	1,603,195.30	0.01
142	688545	兴福电子	11,844	1,575,962.64	0.01
143	000039	中集集团	193,300	1,567,663.00	0.01
144	601727	上海电气	136,600	956,200.00	0.00
144	02727	上海电气	206,000	604,753.99	0.00
145	688233	神工股份	7,278	1,560,548.76	0.01
146	603296	华勤技术	20,860	1,549,272.20	0.01
147	002203	海亮股份	66,200	1,512,670.00	0.01
148	688409	富创精密	4,751	1,454,993.75	0.01
149	603186	华正新材	6,400	1,441,920.00	0.01
150	002850	科达利	7,500	1,419,750.00	0.01
151	600893	航发动力	36,900	1,414,746.00	0.01
152	603259	药明康德	11,200	1,394,512.00	0.01
153	03858	佳鑫国际资源	28,000	1,389,853.71	0.01
154	000425	徐工机械	170,100	1,376,109.00	0.01
155	688120	华海清科	4,194	1,351,222.92	0.01
156	301611	珂玛科技	7,500	1,350,525.00	0.01
157	300568	星源材质	72,100	1,349,712.00	0.01
158	688628	优利德	13,536	1,339,251.84	0.01
159	601100	恒立液压	12,400	1,333,744.00	0.01
160	002555	三七互娱	69,100	1,303,917.00	0.01
161	600971	恒源煤电	188,900	1,303,410.00	0.01
162	603083	剑桥科技	5,100	1,299,837.00	0.01
163	000510	新金路	52,300	1,299,132.00	0.01
164	300666	江丰电子	3,500	1,290,100.00	0.01
165	001979	招商蛇口	199,500	1,282,785.00	0.01
166	605358	立昂微	16,100	1,249,360.00	0.01
167	600595	中孚实业	217,800	1,224,036.00	0.01
168	09633	农夫山泉	34,800	1,197,535.89	0.01
169	002290	禾盛新材	12,700	1,166,749.00	0.01
170	000688	国城矿业	33,100	1,133,013.00	0.01
171	002448	中原内配	89,800	1,104,540.00	0.01
172	002396	星网锐捷	57,290	1,098,249.30	0.01
173	002222	福晶科技	11,800	1,088,904.00	0.01
174	002244	滨江集团	143,100	1,087,560.00	0.01
175	300782	卓胜微	9,900	1,084,842.00	0.01
176	603308	应流股份	17,900	1,081,160.00	0.01
177	688002	睿创微纳	6,944	1,074,167.36	0.01

178	603345	安井食品	8,100	649,539.00	0.00
178	02648	安井食品	7,400	418,736.64	0.00
179	301489	思泉新材	6,480	1,066,478.40	0.01
180	002001	新 和 成	37,500	1,065,750.00	0.01
181	002636	金安国纪	8,800	1,055,736.00	0.01
182	600078	澄星股份	74,200	1,054,382.00	0.01
183	300415	伊之密	52,700	1,049,257.00	0.01
184	000973	佛塑科技	72,700	1,043,245.00	0.01
185	605117	德业股份	9,800	1,040,564.00	0.01
186	300408	三环集团	6,200	1,034,780.00	0.01
187	600105	永鼎股份	15,200	1,025,696.00	0.01
188	600549	厦门钨业	12,000	1,022,400.00	0.01
189	000960	锡业股份	23,800	1,016,022.00	0.01
190	002508	老板电器	68,400	1,000,008.00	0.01
191	002149	西部材料	18,500	999,185.00	0.01
192	688313	仕佳光子	5,402	997,479.30	0.01
193	300322	硕贝德	39,575	997,290.00	0.01
194	688390	固德威	9,183	996,447.33	0.01
195	002859	洁美科技	9,000	985,590.00	0.01
196	301526	国际复材	21,000	980,070.00	0.01
197	300672	国科微	3,300	973,500.00	0.00
198	600985	淮北矿业	69,000	969,450.00	0.00
199	002993	奥海科技	13,500	966,735.00	0.00
200	600809	山西汾酒	8,800	962,456.00	0.00
201	688337	普源精电	12,787	958,129.91	0.00
202	000683	博源化工	166,300	957,888.00	0.00
203	300161	华中数控	32,700	952,224.00	0.00
204	000534	万泽股份	34,700	949,392.00	0.00
205	600926	杭州银行	65,700	949,365.00	0.00
206	002311	海大集团	20,900	932,349.00	0.00
207	000630	铜陵有色	146,500	931,740.00	0.00
208	002240	盛新锂能	20,600	923,498.00	0.00
209	600989	宝丰能源	45,000	914,850.00	0.00
210	603459	红板科技	8,000	897,680.00	0.00
211	300868	杰美特	6,100	894,931.00	0.00
212	001269	欧晶科技	42,900	891,462.00	0.00
213	603067	振华股份	19,100	884,139.00	0.00
214	002241	歌尔股份	38,200	860,646.00	0.00
215	600019	宝钢股份	158,400	860,112.00	0.00
216	301021	英诺激光	7,000	853,300.00	0.00
217	03330	灵宝黄金	78,700	840,081.54	0.00
218	000902	新洋丰	71,500	826,540.00	0.00
219	600096	云天化	27,000	820,800.00	0.00

220	688629	华丰科技	4,365	818,481.15	0.00
221	601225	陕西煤业	39,700	807,895.00	0.00
222	688498	源杰科技	425	801,550.00	0.00
223	688484	南芯科技	14,015	791,707.35	0.00
224	300623	捷捷微电	17,300	778,327.00	0.00
225	300957	贝泰妮	24,600	775,146.00	0.00
226	688396	华润微	7,914	772,010.70	0.00
227	605376	博迁新材	2,800	759,640.00	0.00
228	002415	海康威视	22,000	752,400.00	0.00
229	000932	华菱钢铁	214,480	744,245.60	0.00
230	300593	新雷能	23,900	718,434.00	0.00
231	688126	沪硅产业	17,983	717,341.87	0.00
232	600259	中稀有色	7,000	711,270.00	0.00
233	601187	厦门银行	101,100	690,513.00	0.00
234	688147	微导纳米	4,146	671,154.48	0.00
235	002155	湖南黄金	27,830	664,302.10	0.00
236	600309	万华化学	9,700	663,577.00	0.00
237	300207	欣旺达	34,800	660,852.00	0.00
238	600919	江苏银行	61,200	659,736.00	0.00
239	002602	世纪华通	45,800	645,780.00	0.00
240	603298	杭叉集团	26,900	641,834.00	0.00
241	300438	鹏辉能源	7,600	629,660.00	0.00
242	600909	华安证券	55,700	618,827.00	0.00
243	688691	灿芯股份	5,195	602,256.35	0.00
244	00175	吉利汽车	41,000	600,393.87	0.00
245	002064	华峰化学	62,800	595,972.00	0.00
246	002025	航天电器	7,800	594,516.00	0.00
247	301413	安培龙	8,320	589,721.60	0.00
248	300498	温氏股份	47,300	582,736.00	0.00
249	300972	万辰集团	3,300	572,253.00	0.00
250	00728	中国电信	154,000	571,141.11	0.00
251	603730	岱美股份	50,900	568,553.00	0.00
252	002518	科士达	10,500	562,695.00	0.00
253	688210	统联精密	13,884	562,440.84	0.00
254	002595	豪迈科技	12,035	560,831.00	0.00
255	000596	古井贡酒	6,900	550,620.00	0.00
256	300774	倍杰特	51,100	549,325.00	0.00
257	600841	动力新科	88,200	538,020.00	0.00
258	601118	海南橡胶	109,200	537,264.00	0.00
259	000333	美的集团	7,100	536,263.00	0.00
260	689009	九号公司	14,023	534,977.45	0.00
261	600352	浙江龙盛	44,100	534,051.00	0.00
262	600761	安徽合力	32,500	531,700.00	0.00

263	002192	融捷股份	5,800	518,520.00	0.00
264	002931	锋龙股份	7,400	510,452.00	0.00
265	920045	衡东光	809	509,758.99	0.00
266	002318	久立特材	20,800	497,120.00	0.00
267	601111	中国国航	81,600	493,680.00	0.00
268	600835	上海机电	23,800	490,280.00	0.00
269	002342	巨力索具	46,500	488,715.00	0.00
270	300938	信测标准	9,740	485,831.20	0.00
271	920978	开特股份	22,739	473,653.37	0.00
272	300174	元力股份	16,000	467,520.00	0.00
273	000070	特发信息	22,400	466,816.00	0.00
274	688697	纽威数控	34,092	463,310.28	0.00
275	688321	微芯生物	17,219	453,376.27	0.00
276	000703	恒逸石化	32,200	436,954.00	0.00
277	000888	峨眉山 A	48,800	436,272.00	0.00
278	688510	航亚科技	18,054	431,129.52	0.00
279	600426	华鲁恒升	17,900	428,168.00	0.00
280	600877	电科芯片	24,700	423,111.00	0.00
281	688717	艾罗能源	5,122	422,923.54	0.00
282	688371	菲沃泰	10,724	418,128.76	0.00
283	00148	建滔集团	4,000	409,608.18	0.00
284	00762	中国联通	76,000	403,319.88	0.00
285	688239	航宇科技	6,626	396,433.58	0.00
286	600312	平高电气	22,400	395,584.00	0.00
287	600711	盛屯矿业	35,900	393,823.00	0.00
288	01339	中国人民保险集团	96,000	391,055.95	0.00
289	03393	威胜控股	22,000	379,104.70	0.00
290	600141	兴发集团	8,000	375,760.00	0.00
291	688281	华秦科技	7,322	367,784.06	0.00
292	02513	智谱	200	365,485.84	0.00
293	600562	国睿科技	17,000	360,740.00	0.00
294	02601	中国太保	15,400	359,538.01	0.00
295	09911	赤子城科技	52,000	340,992.73	0.00
296	300054	鼎龙股份	3,197	338,786.09	0.00
297	300394	天孚通信	1,020	308,733.60	0.00
298	300602	飞荣达	6,000	307,200.00	0.00
299	688387	信科移动	15,407	305,674.88	0.00
300	600482	中国动力	9,200	301,760.00	0.00
301	601089	福元医药	18,100	294,668.00	0.00
302	603801	志邦家居	54,200	294,306.00	0.00
303	603605	珀莱雅	4,800	287,616.00	0.00
304	600075	新疆天业	70,300	284,012.00	0.00
305	600029	南方航空	52,800	273,504.00	0.00

306	02259	紫金黄金国际	3,500	269,033.36	0.00
307	01164	中广核矿业	125,000	264,907.75	0.00
308	600418	江淮汽车	10,200	263,466.00	0.00
309	002444	巨星科技	8,000	248,800.00	0.00
310	06088	FIT HON TENG	40,170	248,065.44	0.00
311	603893	瑞芯微	1,300	244,868.00	0.00
312	002028	思源电气	1,400	242,200.00	0.00
313	600010	包钢股份	108,200	241,286.00	0.00
314	601799	星宇股份	2,600	235,612.00	0.00
315	02698	乐舒适	10,800	234,508.50	0.00
316	000831	中国稀土	4,200	233,058.00	0.00
317	920522	纳科诺尔	9,397	222,708.90	0.00
318	688605	先锋精科	2,074	215,737.48	0.00
319	002922	伊戈尔	6,500	213,200.00	0.00
320	688027	国盾量子	391	197,067.91	0.00
321	06990	科伦博泰生物	500	189,430.76	0.00
322	600298	安琪酵母	5,100	184,620.00	0.00
323	300751	迈为股份	600	169,476.00	0.00
324	302132	中航成飞	2,900	169,128.00	0.00
325	02628	中国人寿	7,000	162,088.80	0.00
326	688668	鼎通科技	425	158,652.50	0.00
327	01336	新华保险	3,600	143,894.42	0.00
328	002653	海思科	2,100	139,314.00	0.00
329	06181	老铺黄金	400	120,346.29	0.00
330	688082	盛美上海	278	120,096.00	0.00

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	601899	紫金矿业	122,229,764.80	2.91
2	300308	中际旭创	75,812,408.70	1.80
3	300502	新易盛	65,447,021.93	1.56
4	00981	中芯国际	26,610,974.22	0.63
5	688256	寒武纪	18,708,487.59	0.44
6	002384	东山精密	16,668,303.00	0.40
7	00700	腾讯控股	15,887,025.19	0.38
8	09988	阿里巴巴-W	15,393,513.94	0.37
9	300750	宁德时代	14,633,554.00	0.35
10	688041	海光信息	14,058,969.12	0.33
11	601168	西部矿业	13,984,047.21	0.33
12	002916	深南电路	13,929,635.30	0.33
13	002436	兴森科技	12,837,433.00	0.31
14	601138	工业富联	11,229,735.90	0.27

15	603986	兆易创新	10,579,838.00	0.25
16	300274	阳光电源	9,674,701.00	0.23
17	300223	北京君正	9,670,300.76	0.23
18	002475	立讯精密	9,667,368.00	0.23
19	600183	生益科技	9,465,845.00	0.23
20	688778	厦钨新能	9,148,355.51	0.22

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	002384	东山精密	5,457,045.46	0.13
2	600961	株冶集团	4,924,445.00	0.12
3	301150	中一科技	3,535,587.78	0.08
4	688676	金盘科技	3,400,368.17	0.08
5	300870	欧陆通	3,338,175.00	0.08
6	688195	腾景科技	3,332,463.75	0.08
7	688146	中船特气	3,087,005.06	0.07
8	603187	海容冷链	3,035,303.00	0.07
9	000528	柳 工	2,993,746.00	0.07
10	300285	国瓷材料	2,914,569.00	0.07
11	300274	阳光电源	2,824,155.00	0.07
12	000960	锡业股份	2,776,833.00	0.07
13	09626	哔哩哔哩-W	2,561,584.49	0.06
14	000977	浪潮信息	2,560,978.00	0.06
15	601918	新集能源	2,501,913.00	0.06
16	603993	洛阳钼业	2,484,490.00	0.06
17	000725	京东方 A	2,097,151.00	0.05
18	601688	华泰证券	2,018,818.00	0.05
19	300548	长芯博创	1,988,353.00	0.05
20	688548	广钢气体	1,961,075.44	0.05

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	1,121,518,497.89
卖出股票收入（成交）总额	301,014,716.16

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	193,934,715.21	0.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,309,078,679.72	16.92
	其中：政策性金融债	911,940,134.25	4.66
4	企业债券	7,434,260,739.35	38.02
5	企业短期融资券	440,843,435.06	2.25
6	中期票据	6,053,099,359.22	30.96
7	可转债（可交换债）	193,009.40	0.00
8	同业存单	495,028,076.37	2.53
9	其他	500,354,082.28	2.56
10	合计	18,426,792,096.61	94.24

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	245316	26GHTY5	7,900,000	790,561,873.99	4.04
2	240403	24 农发 03	5,100,000	516,144,032.88	2.64
3	245396	26 银河 Y3	5,000,000	500,938,356.15	2.56
4	332580001	25 工行科创债 01BC	4,800,000	482,578,586.30	2.47
5	232480007	24 建行二级资 本债 01B	3,600,000	383,732,640.00	1.96

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

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

7.10.2 本期国债期货投资评价

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

7.11 本报告期投资基金情况

7.11.1 投资政策及风险说明

1、投资政策

本基金可投资经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（仅限于基金管理人旗下的股票型基金及应计入权益类资产的混合型基金、全市场的股票型 ETF，不包含 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、货币市场基金和其他投资范围包含基金的基金）。其中上述应计入权益类资产的混合型基金指根据定期报告披露情况，最近连续四个季度季末股票资产占基金资产的比例均在 60%以上的混合型基金。

本基金管理人根据七大指标，即基金分类、基金风格、基金运作情况、中长期业绩、归因分析和基金经理及基金管理人，对子基金进行定性及定量的分析，从而综合评价及打分并纳入基金库。

2、风险说明

本基金可投资经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（仅限于基金管理人旗下的股票型基金及应计入权益类资产的混合型基金、全市场的股票型 ETF，不包含 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、货币市场基金和其他投资范围包含基金的基金）。其中上述应计入权益类资产的混合型基金指根据定期报告披露情况，最近连续四个季度季末股票资产占基金资产的比例均在 60%以上的混合型基金。

（1）本基金可以投资于其他公开募集证券投资基金的基金份额，因此本基金所持有的基金的业绩表现、持有基金的基金管理人水平等因素将影响到本基金的基金业绩表现。

（2）本基金可以投资于其他公开募集的基金，除了持有的本基金管理人管理的其他基金部分不收取管理费，持有本基金托管人托管的其他基金部分不收取托管费，申购本基金管理人管理的其他基金不收取申购费、赎回费（不包括按照基金合同应归入基金资产的部分）等，本基金承担的相关基金费用可能比普通开放式基金高。

（3）本基金投资流通受限基金时，对于封闭式基金而言，当要卖出基金的时候，可能会面临在一定的价格下无法卖出而要降价卖出的风险；对于流通受限基金而言，由于流通受限基金的非流通特性，在本基金参与投资后将在一定的期限内无法流通。

（4）巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过前一工作日基金总份额的百分之十时，本基金将可能无法及时赎回持有的全部基金份额，影响本基金的资金安排。

（5）本基金会面临基金价格变动的风险。如果基金价格下降到买入成本之下，在不考虑分红

因素影响的情况下，本基金将面临亏损风险。

7.11.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	510300	华泰柏瑞沪深300ETF	交易型开放式 (ETF)	37,743,596.00	189,435,108.32	0.97	否
2	159915	创业板	交易型开放式 (ETF)	19,538,500.00	85,266,014.00	0.44	否
3	159919	沪深300	交易型开放式 (ETF)	7,431,300.00	38,887,992.90	0.20	否
4	588000	华夏上证科创板50成份ETF	交易型开放式 (ETF)	8,509,100.00	19,945,330.40	0.10	否
5	515880	国泰中证全指通信设备ETF	交易型开放式 (ETF)	9,088,600.00	16,323,125.60	0.08	否
6	510500	南方中证500ETF	交易型开放式 (ETF)	1,555,700.00	14,303,105.80	0.07	否
7	159952	创业ETF	交易型开放式 (ETF)	3,304,600.00	8,757,190.00	0.04	否

8	512000	华宝中证全指证券公司 ETF	交易型开放式 (ETF)	15,520,900.00	8,334,723.30	0.04	否
9	512400	南方中证申万有色金属 ETF	交易型开放式 (ETF)	3,500,600.00	6,490,112.40	0.03	否
10	512890	华泰柏瑞中证红利低波动 ETF	交易型开放式 (ETF)	4,697,500.00	5,012,232.50	0.03	否
11	159870	化工 ETF	交易型开放式 (ETF)	4,940,100.00	4,258,366.20	0.02	否
12	512100	南方中证 1000ETF	交易型开放式 (ETF)	1,136,600.00	4,065,618.20	0.02	否
13	588050	科创 50ETF 工银	交易型开放式 (ETF)	1,384,822.00	3,153,239.69	0.02	否
14	563300	华泰柏瑞中证 2000ETF	交易型开放式 (ETF)	1,846,700.00	2,971,340.30	0.02	否
15	159805	传媒 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,110,100.00	1,267,734.20	0.01	否
16	159570	创新药 HK	交易型开放式 (ETF)	413,500.00	520,596.50	0.00	否

7.11.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

本基金本报告期末未持有公开募集不动产投资信托基金。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局处罚。

中国工商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、国家外汇管理局地方分局、国家金融监督管理总局处罚。

中国建设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、国家金融监督管理总局处罚。

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。

7.12.2 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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	691,413.42
2	应收清算款	25,886,564.76
3	应收股利	483,893.19
4	应收利息	-
5	应收申购款	280,616,867.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	307,678,738.49

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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 景颐裕利 债券 A	108,132	69,574.78	407,236,872.19	5.41	7,116,022,721.01	94.59
景顺长城 景颐裕利 债券 C	245,187	30,222.14	109,936,705.30	1.48	7,300,139,557.33	98.52
景顺长城 景颐裕利 债券 F	633	3,115,079.31	1,936,039,549.47	98.18	35,805,653.00	1.82
合计	353,952	47,761.22	2,453,213,126.96	14.51	14,451,967,931.34	85.49

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	景顺长城景颐裕利债券 A	1,992,615.08	0.026486
	景顺长城景颐裕利债券 C	6,271.81	0.000085
	景顺长城景颐裕利债券 F	912.16	0.000046
	合计	1,999,799.05	0.011830

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	景顺长城景颐裕利债券 A	50~100
	景顺长城景颐裕利债券 C	—
	景顺长城景颐裕利债券 F	—
	合计	50~100

本基金基金经理持有 本开放式基金	景顺长城景颐裕利债券 A	50~100
	景顺长城景颐裕利债券 C	—
	景顺长城景颐裕利债券 F	—
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城景颐裕利债券 A	景顺长城景颐裕利债券 C	景顺长城景颐裕利债券 F
基金合同生效 日（2023 年 11 月 16 日）基金 份额总额	485,175,698.88	2,500,437,544.43	—
本报告期期初 基金份额总额	1,149,800,813.13	1,670,123,514.50	957,103,650.93
本报告期基金 总申购份额	8,163,863,275.98	9,482,256,246.35	2,067,888,081.51
减：本报告期 基金总赎回份 额	1,790,404,495.91	3,742,303,498.22	1,053,146,529.97
本报告期基金 拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末 基金份额总额	7,523,259,593.20	7,410,076,262.63	1,971,845,202.47

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：
报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。
基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：
报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，无涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人受调查或处罚等情况。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金托管人受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.8.1 基金租用或者通过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 (%)	
国金证券股份有限公司	1	185,782,553.67	13.06	84,530.20	13.07	未变更
华创证券有限责任公司	1	141,157,262.13	9.92	64,226.55	9.93	未变更
广发证券股份有限公司	2	130,610,102.48	9.18	59,426.80	9.19	未变更
长江证券股份有限公司	2	122,256,318.10	8.59	55,627.38	8.60	未变更
光大证券	2	117,820,158.	8.28	53,608.04	8.29	未变

股份有限公司		36				更
国信证券股份有限公司	2	113,422,039.84	7.97	51,607.30	7.98	未变更
东方证券股份有限公司	2	93,835,999.94	6.60	42,695.50	6.60	未变更
兴业证券股份有限公司	1	88,058,062.51	6.19	40,066.18	6.20	未变更
华泰证券股份有限公司	1	76,061,668.18	5.35	34,607.94	5.35	未变更
民生证券股份有限公司	1	69,863,615.39	4.91	31,788.13	4.92	未变更
申万宏源证券有限公司	2	57,609,249.49	4.05	26,212.17	4.05	未变更
华福证券股份有限公司	1	57,065,866.11	4.01	25,964.96	4.02	未变更
中国国际金融股份有限公司	2	54,460,115.52	3.83	24,779.30	3.83	未变更
国盛证券股份有限公司	1	36,551,677.47	2.57	16,631.56	2.57	未变更
中信证券股份有限公司	5	35,502,697.29	2.50	15,451.20	2.39	未变更
天风证券股份有限公司	1	19,887,344.56	1.40	9,048.74	1.40	未变更
东方财富证券股份有限公司	2	18,610,078.76	1.31	8,467.39	1.31	未变更
中国银河证券股份有限公司	2	3,978,404.25	0.28	1,810.18	0.28	未变更
长城证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更

诚通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
国泰海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中信建投证券股份有限公司	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。

10.8.2 基金租用或者通过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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
--------	------	--------	------	------

名称	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	978,293,316.46	9.67	54,000,000.00	0.47	-	-	27,083,633.50	6.33
华创证券有限责任公司	1,397,382,351.65	13.81	1,432,397,000.00	12.58	-	-	79,489,198.81	18.57
广发证券股份有限公司	750,063,264.52	7.41	955,000,000.00	8.39	-	-	58,605,496.62	13.69
长江	217,130,935.14	2.15	10,000,000.00	0.09	-	-	32,359,738.21	7.56

证 券 股 份 有 限 公 司								
光 大 证 券 股 份 有 限 公 司	93,172,221.42	0.92	421,476,000.00	3.70	-	-	10,718,497.90	2.50
国 信 证 券 股 份 有 限 公 司	1,403,478,443.68	13.87	1,477,530,000.00	12.98	-	-	42,884,665.31	10.02
东 方 证 券 股 份 有 限 公 司	163,329,164.15	1.61	246,000,000.00	2.16	-	-	36,923,211.80	8.63
兴 业 证 券 股 份 有	123,346,939.82	1.22	27,000,000.00	0.24	-	-	16,546,595.49	3.87

限公司								
华泰证券股份有限公司	65,904,042.93	0.65	236,633,000.00	2.08	-	-	68,467,870.40	15.99
民生证券股份有限公司	221,598,816.37	2.19	48,600,000.00	0.43	-	-	16,247,592.10	3.80
申万宏源证券有限公司	1,583,030,021.09	15.64	2,148,000,000.00	18.87	-	-	3,119,283.00	0.73
华福证券股份有限公司	2,032,954,030.65	20.09	3,145,000,000.00	27.62	-	-	19,096,329.52	4.46
中国	271,896,591.81	2.69	567,000,000.00	4.98	-	-	8,855,905.30	2.07

国际金融股份有限公司								
国盛证券股份有限公司	-	-	11,500,000.00	0.10	-	-	1,555,822.60	0.36
中信证券股份有限公司	432,954,284.35	4.28	392,000,000.00	3.44	-	-	679,379.50	0.16
天风证券股份有限公司	907,341.13	0.01	-	-	-	-	-	-
东方财富证	13,129,828.24	0.13	4,000,000.00	0.04	-	-	4,824,436.30	1.13

券股份 有限公司								
中国银 河证 券股 份有 限公 司	-	-	210,000,000.00	1.84	-	-	623,569.90	0.15
长城证 券股 份有 限公 司	10,111,800.27	0.10	-	-	-	-	-	-
诚通证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券股 份	-	-	-	-	-	-	-	-

有 限 公 司								
东 兴 证 券 股 份 有 限 公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
方 正 证 券 股 份 有 限 公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
国 泰 海 通 证 券 股 份 有 限 公 司	361,409,807.42	3.57	-	-	-	-	-	-
国 投 证 券 股 份 有 限 公 司	-	-	-	-	-	-	-	-

司								
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

证 券 股 份 有 限 公 司								
--------------------------------------	--	--	--	--	--	--	--	--

10.9 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 2026 年非港股通交易日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回及转换业务安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 12 日
2	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增中欧财富为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 14 日
3	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	2026 年 1 月 20 日
4	景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 22 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 22 日
6	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	2026 年 1 月 27 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国民生银行股份有限公司民生同业 e+平台为销售平台的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 11 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增湘财证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 13 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	2026 年 2 月 25 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 26 日
11	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	2026 年 3 月 25 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 27 日
13	景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 27 日
14	景顺长城基金管理有限公司旗下公募	中国证监会指定报刊及	2026 年 3 月 31 日

	基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)	网站	
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 1 日
16	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	2026 年 4 月 7 日
17	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	2026 年 4 月 21 日
18	景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 22 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 22 日
20	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	2026 年 4 月 29 日
21	2025 年度景顺长城基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 29 日
22	景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金 2026 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 30 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于调整景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金销售对象及申购限制并相应修改基金合同、招募说明书部分条款的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 30 日
24	景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金基金合同（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 30 日
25	关于景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金新增交通银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 6 日
26	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	2026 年 5 月 12 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于部分基金投顾组合终止的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 13 日
28	关于景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金新增东莞银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 15 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 21 日
30	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	2026 年 5 月 21 日
31	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 22 日

	通知		
32	景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金 2026 年 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 23 日
33	景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 23 日
34	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	2026 年 5 月 27 日
35	景顺长城基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售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	2026 年 5 月 29 日
36	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	2026 年 6 月 2 日
37	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	2026 年 6 月 9 日
38	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	2026 年 6 月 23 日
39	景顺长城基金管理有限公司关于暂停浦领基金销售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	2026 年 6 月 24 日
40	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增汇添富财富为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 25 日
41	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 26 日
42	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 29 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足投资者的理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，景顺长城基金管理有限公司决定自 2026 年 5 月 6 日起调整景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金的销售对象及申购限制，同时对《基金合同》和招募说明书进行了相应的修改。详情请参阅本基金管理人于 2026 年 4 月 30 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于调整景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金销售对象及申购限制并相应修改基金合同、招募说明书部分条款的公告》。

§ 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颐裕利债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城景颐裕利债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城景颐裕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

2026 年 8 月 28 日