

# 景顺长城景颐双利债券型证券投资基金

## 2021 年第 2 季度报告

2021 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：北京银行股份有限公司

报告送出日期：2021 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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 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 2021 年 04 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 景顺长城景颐双利债券                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 场内简称       | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 基金主代码      | 000385                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金合同生效日    | 2013 年 11 月 13 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 报告期末基金份额总额 | 1,977,378,185.42 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 投资目标       | 本基金主要通过投资于固定收益品种，在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 投资策略       | <p>1、资产配置策略：本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会，根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略：</p> <p>债券类属资产配置：基金管理人根据国债、金融债、企业（公司）债、分离交易可转债债券部分等品种与同期限国债或央票之间收益率利差的扩大和收窄的分析，主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。</p> <p>债券投资策略：债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极</p> |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                           |                  |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|
|                 | <p>性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>资产支持证券投资策略：本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> |                  |
| 业绩比较基准          | 三年期银行定期存款利率（税后）+1.5%。                                                                                                                                                                                                                                                     |                  |
| 风险收益特征          | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。                                                                                                                                                                                                           |                  |
| 基金管理人           | 景顺长城基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                              |                  |
| 基金托管人           | 北京银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 景顺长城景颐双利债券 A 类                                                                                                                                                                                                                                                            | 景顺长城景颐双利债券 C 类   |
| 下属分级基金的交易代码     | 000385                                                                                                                                                                                                                                                                    | 000386           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,815,642,861.92 份                                                                                                                                                                                                                                                        | 161,735,323.50 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（2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日） |                |
|-----------------|-------------------------------------|----------------|
|                 | 景顺长城景颐双利债券 A 类                      | 景顺长城景颐双利债券 C 类 |
| 1. 本期已实现收益      | 23,478,453.57                       | 1,305,414.49   |
| 2. 本期利润         | 66,402,686.54                       | 3,612,957.02   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0568                              | 0.0513         |
| 4. 期末基金资产净值     | 2,962,890,499.38                    | 256,042,138.21 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.632                               | 1.583          |

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城景颐双利债券 A 类

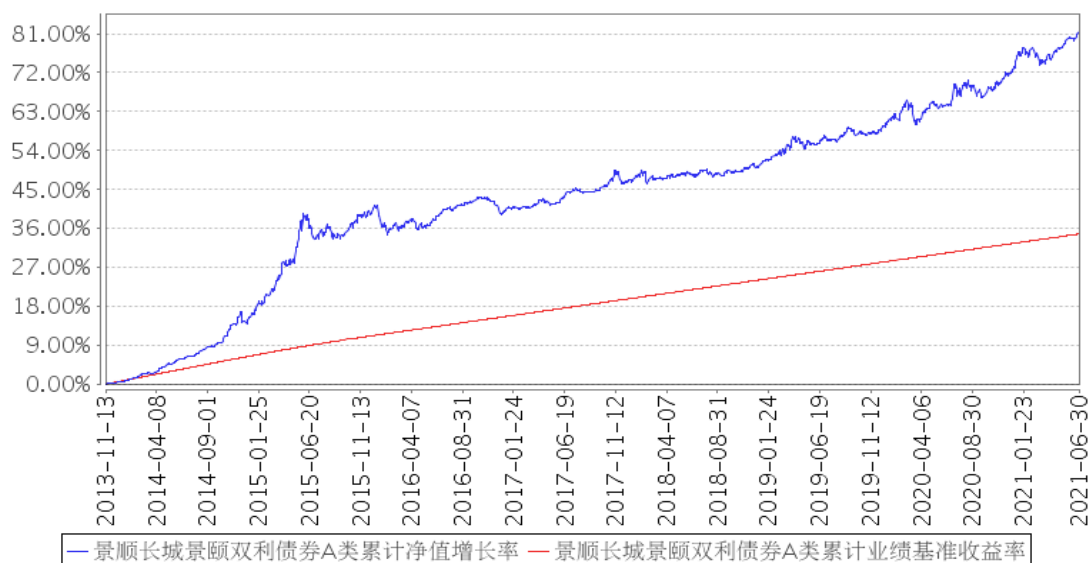
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 3.62%  | 0.14%     | 0.79%      | 0.01%         | 2.83%  | 0.13% |
| 过去六个月      | 3.95%  | 0.24%     | 1.59%      | 0.01%         | 2.36%  | 0.23% |
| 过去一年       | 9.97%  | 0.28%     | 3.25%      | 0.01%         | 6.72%  | 0.27% |
| 过去三年       | 22.14% | 0.23%     | 10.45%     | 0.01%         | 11.69% | 0.22% |
| 过去五年       | 30.02% | 0.20%     | 18.73%     | 0.01%         | 11.29% | 0.19% |
| 自基金合同生效起至今 | 81.38% | 0.24%     | 34.73%     | 0.01%         | 46.65% | 0.23% |

景顺长城景颐双利债券 C 类

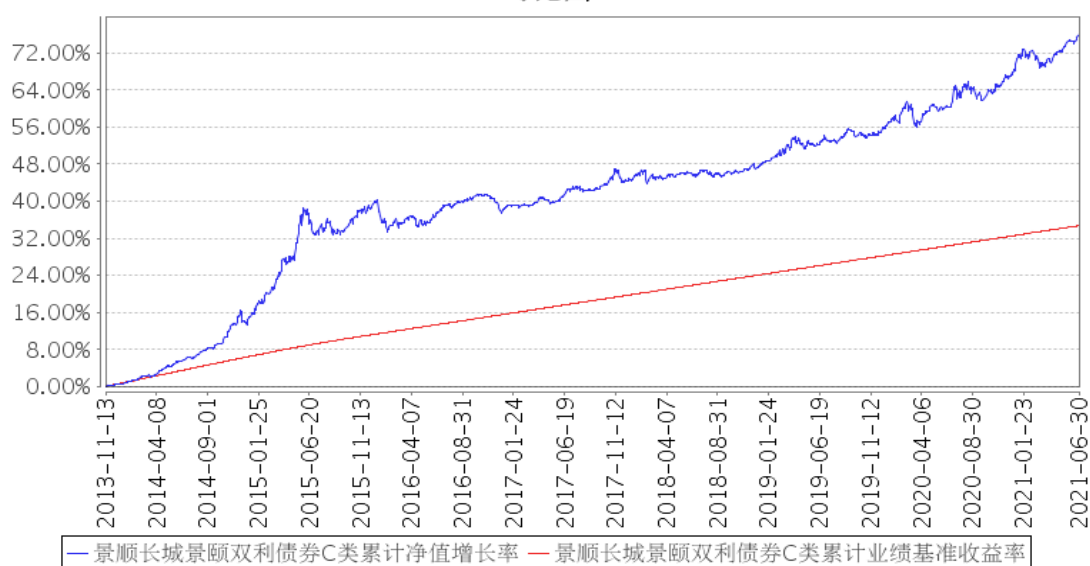
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 3.46%  | 0.14%     | 0.79%      | 0.01%         | 2.67%  | 0.13% |
| 过去六个月      | 3.67%  | 0.24%     | 1.59%      | 0.01%         | 2.08%  | 0.23% |
| 过去一年       | 9.55%  | 0.27%     | 3.25%      | 0.01%         | 6.30%  | 0.26% |
| 过去三年       | 20.57% | 0.23%     | 10.45%     | 0.01%         | 10.12% | 0.22% |
| 过去五年       | 27.38% | 0.20%     | 18.73%     | 0.01%         | 8.65%  | 0.19% |
| 自基金合同生效起至今 | 75.91% | 0.24%     | 34.73%     | 0.01%         | 41.18% | 0.23% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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



注：本基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2013 年 11 月 13 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

### 3.3 其他指标

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理期限      |                 | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                     |
|-----|----------|------------------|-----------------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          | 任职日期             | 离任日期            |        |                                                                                                                        |
| 毛从容 | 本基金的基金经理 | 2014 年 1 月 16 日  | 2021 年 4 月 29 日 | 21 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 21 年证券、基金行业从业经验。 |
| 董晗  | 本基金的基金经理 | 2020 年 10 月 30 日 | —               | 15 年   | 理学硕士。曾任易方达基金管理有限公司研究部研究员，国投瑞银基金管理有限公司研究部研究员、投资部基金经理。2020 年 7 月加入本公司，自 2020 年 10 月起担任股票投资部基金经理。具有 15 年证券、基金行业从业经验。      |

|     |              |                    |   |      |                                                                                                                                                                       |
|-----|--------------|--------------------|---|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 李怡文 | 本基金的<br>基金经理 | 2021 年 4 月 30<br>日 | - | 15 年 | 工商管理硕士。曾任国家外汇管理局会计处组合分析师，弗罗里瑞伟投资管理公司研究员，中国建设银行香港组合管理经理，国投瑞银基金管理有限公司固定收益部副总监、基金经理。2020 年 4 月加入本公司，自 2021 年 4 月起担任固定收益部基金经理，现任固定收益部稳定收益业务投资负责人、基金经理。具有 15 年证券、基金行业从业经验。 |
|-----|--------------|--------------------|---|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城景颐双利债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 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

相比 1 季度，2021 年 2 季度经济增速开始出现环比放缓迹象，受益于较好的出口以及较强韧性的房地产投资，经济下行趋势比较平缓；其中受局部疫情反复、收入恢复不均，国内消费恢复节奏偏慢，但整体方向保持向上；之前被市场寄予厚望的制造业投资受高企的原材料价格以及偏低的财政支出影响，回升速度较慢。

债券方面，受持续宽松的资金面及环比走弱的经济基本面推动，2 季度债券收益率持续下行，10 年期国开债收益率回落近 10bp，而短端收益率下行幅度更大，1 年期国开债下行幅度超过 30BP。

权益市场方面，指数整体以反弹为主，但行业分化严重：受产品价格涨价带动，以煤炭、有色、化工为代表的顺周期行业表现突出，同时持续高景气的新能源行业、半导体、医药行业继 1 季度抛售后，在 2 季度也出现大幅反弹，而部分受经济景气程度影响较大的行业和个股则跌幅较大。上证指数当季上涨 4.34%，沪深 300 上涨 3.48%，创业板指涨 26%，破前期高点。

2 季度本基金由于规模增长，继续增加了对高等级信用债以及长久期利率债的配置。对于股票组合，我们进一步减仓，结构上重点配置中长期景气度较为确认、和经济相关程度相对较低的板块和个股。

展望下半年，从经济基本面看，上半年韧性较高的地产投资和景气程度较强的出口在下半年均有回落风险，短期内经济回落的趋势仍在延续，短期内还看不到企稳的迹象。而进入 3 季度，美联储货币政策也进入一个敏感时点，未来美联储或将释放关于减少债券资产购买的政策指引，海外市场流动性也将面临一定的边际收紧。因此，我们对于国内债券市场保持相对乐观的态度，对股票市场则保持相对谨慎，我们将维持相对较低的股票仓位，等待合适的配置机会。行业上我们将继续重点关注并配置能源革命中的新能源行业、制造业升级过程中进口替代空间大的高端基础材料和新材料行业、汽车电动化智能化产业链、5G 应用落地带动可穿戴相关的消费电子产业链以及国家安全领域等的行业和个股。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2021 年 2 季度，景顺长城景颐双利债券 A 类份额净值增长率为 3.62%，业绩比较基准收益率为 0.79%。

2021 年 2 季度，景顺长城景颐双利债券 C 类份额净值增长率为 3.46%，业绩比较基准收益率为 0.79%。

#### 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              | 253,498,286.81   | 7.62         |
|    | 其中：股票             | 253,498,286.81   | 7.62         |
| 2  | 基金投资              | —                | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 2,647,819,964.94 | 79.62        |
|    | 其中：债券             | 2,647,819,964.94 | 79.62        |
|    | 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          | 369,505,289.84   | 11.11        |
|    | 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      | 15,228,959.61    | 0.46         |
| 8  | 其他资产              | 39,676,690.65    | 1.19         |
| 9  | 合计                | 3,325,729,191.85 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —              | —            |
| B  | 采矿业              | 9,696,384.00   | 0.30         |
| C  | 制造业              | 215,328,046.81 | 6.69         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —              | —            |
| E  | 建筑业              | —              | —            |
| F  | 批发和零售业           | —              | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —              | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 5,647,916.00   | 0.18         |
| J  | 金融业              | 22,825,940.00  | 0.71         |
| K  | 房地产业             | —              | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | —              | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —              | —            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | —              | —            |

|   |               |                |      |
|---|---------------|----------------|------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | —              | —    |
| P | 教育            | —              | —    |
| Q | 卫生和社会工作       | —              | —    |
| R | 文化、体育和娱乐业     | —              | —    |
| S | 综合            | —              | —    |
|   | 合计            | 253,498,286.81 | 7.88 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量（股）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 600036 | 招商银行  | 351,400 | 19,042,366.00 | 0.59         |
| 2  | 000858 | 五 粮 液 | 59,500  | 17,724,455.00 | 0.55         |
| 3  | 688116 | 天奈科技  | 145,100 | 16,663,800.00 | 0.52         |
| 4  | 300750 | 宁德时代  | 23,000  | 12,300,400.00 | 0.38         |
| 5  | 002311 | 海大集团  | 140,200 | 11,440,320.00 | 0.36         |
| 6  | 601636 | 旗滨集团  | 601,800 | 11,169,408.00 | 0.35         |
| 7  | 688002 | 睿创微纳  | 110,565 | 11,037,703.95 | 0.34         |
| 8  | 600456 | 宝钛股份  | 239,330 | 10,267,257.00 | 0.32         |
| 9  | 600060 | 海信视像  | 600,000 | 10,140,000.00 | 0.32         |
| 10 | 000568 | 泸州老窖  | 41,400  | 9,767,916.00  | 0.30         |

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

无。

## 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      | 245,971,356.80 | 7.64         |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | 302,176,000.00 | 9.39         |
|    | 其中：政策性金融债 | 262,064,000.00 | 8.14         |
| 4  | 企业债券      | 816,892,000.00 | 25.38        |
| 5  | 企业短期融资券   | 80,016,000.00  | 2.49         |
| 6  | 中期票据      | 936,676,400.00 | 29.10        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 266,088,208.14 | 8.27         |
| 8  | 同业存单      | —              | —            |

|    |    |                  |       |
|----|----|------------------|-------|
| 9  | 其他 | -                | -     |
| 10 | 合计 | 2,647,819,964.94 | 82.26 |

### 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  | 200012    | 20 付息国债 12     | 1,200,000 | 123,048,000.00 | 3.82         |
| 2  | 132015    | 18 中油 EB       | 1,190,930 | 121,772,592.50 | 3.78         |
| 3  | 200215    | 20 国开 15       | 1,200,000 | 121,668,000.00 | 3.78         |
| 4  | 102101011 | 21 国家能源 MTN001 | 1,200,000 | 119,604,000.00 | 3.72         |
| 5  | 149424    | 21 广铁 02       | 1,100,000 | 110,473,000.00 | 3.43         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.9.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

#### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.9.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 5.10 投资组合报告附注

#### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

1、招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，股票代码：600036）于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字〔2021〕16 号）。其因

为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品、理财产品之间风险隔离不到位等二十七项违法违规事实，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，被处以罚款 7170 万元。

招商银行于 2020 年 7 月 28 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书(沪银保监银罚决字(2020)7 号)。其信用卡中心因某客户个人信息未尽安全保护义务、对部分信用卡催收外包管理严重不审慎，被处以 100 万元罚款。

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招商银行进行了投资。

2、国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书(银保监罚决字〔2020〕67 号)。其因为违规的政府购买服务项目提供融资等多项违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则规定，被处以罚款 4880 万元罚款。

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国家开发银行债券进行了投资。

3、广州地铁集团有限公司（以下简称“广州地铁”）因未经批准或者采取欺骗手段骗取批准、违法占用土地等违法违规行为，违反了《中华人民共和国土地管理法》等相关规定，广州市规划和自然资源局分别于 2021 年 1 月 29 日、2021 年 4 月 23 日、2021 年 6 月 23 日、2021 年 6 月 23 日出具行政处罚决定书，对其进行相应罚款。

广州地铁集团有限公司（以下简称“广州地铁”）因未经批准或者采取欺骗手段骗取批准、违法占用土地等违法违规行为，违反了《中华人民共和国土地管理法》等相关规定，广州市规划和自然资源局分别于 2021 年 1 月 29 日、2021 年 4 月 23 日、2021 年 6 月 23 日、2021 年 6 月 23 日出具行政处罚决定书，对其进行相应罚款。

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广州地铁进行了投资。

4、其余七名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**5.10.3 其他资产构成**

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 530,049.10    |
| 2  | 应收证券清算款 | 6,616,867.91  |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 26,855,999.58 |
| 5  | 应收申购款   | 5,673,774.06  |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 39,676,690.65 |

**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  | 132015 | 18 中油 EB | 121,772,592.50 | 3.78         |
| 2  | 132009 | 17 中油 EB | 52,102,386.00  | 1.62         |
| 3  | 132004 | 15 国盛 EB | 29,839,887.00  | 0.93         |
| 4  | 113563 | 柳药转债     | 10,527,841.40  | 0.33         |
| 5  | 113037 | 紫银转债     | 8,556,919.80   | 0.27         |
| 6  | 132007 | 16 凤凰 EB | 7,492,655.40   | 0.23         |
| 7  | 127020 | 中金转债     | 5,052,562.60   | 0.16         |
| 8  | 128048 | 张行转债     | 4,131,591.20   | 0.13         |
| 9  | 123066 | 赛意转债     | 2,166,500.00   | 0.07         |
| 10 | 128109 | 楚江转债     | 991,370.80     | 0.03         |
| 11 | 132022 | 20 广版 EB | 350,945.00     | 0.01         |
| 12 | 113611 | 福 20 转债  | 344,180.00     | 0.01         |
| 13 | 128123 | 国光转债     | 196,432.74     | 0.01         |
| 14 | 110073 | 国投转债     | 107,710.00     | 0.00         |

**5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 688116 | 天奈科技 | 11,342,000.00  | 0.35         | 大宗交易买入限售 |

**5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

| 项目 | 景顺长城景颐双利债券 A 类 | 景顺长城景颐双利债券 C |
|----|----------------|--------------|
|----|----------------|--------------|

|                           |                  | 类              |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 953,821,365.38   | 43,560,992.66  |
| 报告期期间基金总申购份额              | 976,815,450.84   | 127,482,319.58 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 114,993,954.30   | 9,307,988.74   |
| 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               | 1,815,642,861.92 | 161,735,323.50 |

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

## §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

| 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              | 20210507-20210509       | 187,499,375.00 | -    | -    | 187,499,375.00 | 9.48    |

#### 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。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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侧袋机制指引(试行)》等法律法规及本基金基金合同等规定,经与各基金托管人协商一致,并向中国证监会备案,景顺长城基金管理有限公司决定对本基金的基金合同等法律文件进行修订,新增侧袋机制相关内容。本次修订属于法律法规规定无需召开基金份额持有人大会的事项,修订自 2021 年 6 月 18 日起正式生效。有关详细信息参见本公司于 2021 年 6 月 18 日发布的相关公告。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城景颐双利债券型证券投资基金募集注册的文件;
- 2、《景顺长城景颐双利债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《景顺长城景颐双利债券型证券投资基金招募说明书》;
- 4、《景顺长城景颐双利债券型证券投资基金托管协议》;
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

### 9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 9.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2021 年 7 月 21 日