

# 景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 28 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 2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 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             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 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 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>43</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 43        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 43        |
| 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       | 44        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 45        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 47        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....    | 47        |
| 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 ..... | 47        |
| 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 ..... | 47        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....    | 48        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 48        |
| 7.11 本报告期投资基金情况 .....                       | 48        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 49        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>50</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 50        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 50        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 51        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>51</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>51</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 51        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....      | 51        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 51        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 52        |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....               | 52        |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 52        |
| 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 52        |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 52        |
| 10.9 其他重大事件 .....                           | 57        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>59</b> |
| 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 .....    | 59        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 59        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>59</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 59        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 59        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 59        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                   |                  |
|-----------------|-------------------|------------------|
| 基金名称            | 景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金 |                  |
| 基金简称            | 景顺长城景颐辰利债券        |                  |
| 基金主代码           | 018214            |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式            |                  |
| 基金合同生效日         | 2023 年 4 月 28 日   |                  |
| 基金管理人           | 景顺长城基金管理有限公司      |                  |
| 基金托管人           | 中国建设银行股份有限公司      |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 620,936,140.96 份  |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期               |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 景顺长城景颐辰利债券 A      | 景顺长城景颐辰利债券 C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 018214            | 018215           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 290,278,932.65 份  | 330,657,208.31 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 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况进行调整，资产配置组合主要以债券等固定收益类资产配置为主，并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例，使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上优化投资组合。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用债投资策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>4、国债期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、基金投资策略</p> <p>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</p> |

|        |                                                                                                                                              |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 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)。<br>6、信用衍生品投资策略<br>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。 |
| 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 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。                                                                              |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

|               |                                          |              |
|---------------|------------------------------------------|--------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）-2023 年 6 月 30 日 |              |
|               | 景顺长城景颐辰利债券 A                             | 景顺长城景颐辰利债券 C |
| 本期已实现收益       | 779,538.43                               | 659,115.03   |

|                 |                       |                   |
|-----------------|-----------------------|-------------------|
| 本期利润            | 1, 046, 361. 20       | 962, 890. 43      |
| 加权平均基金份额本期利润    | 0. 0036               | 0. 0029           |
| 本期加权平均净值利润率     | 0. 36%                | 0. 29%            |
| 本期基金份额净值增长率     | 0. 36%                | 0. 29%            |
| 3. 1. 2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |                   |
| 期末可供分配利润        | 779, 538. 43          | 659, 115. 03      |
| 期末可供分配基金份额利润    | 0. 0027               | 0. 0020           |
| 期末基金资产净值        | 291, 325, 293. 85     | 331, 620, 098. 74 |
| 期末基金份额净值        | 1. 0036               | 1. 0029           |
| 3. 1. 3 累计期末指标  | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |                   |
| 基金份额累计净值增长率     | 0. 36%                | 0. 29%            |

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。

5、本基金基金合同生效日为 2023 年 4 月 28 日。

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

景顺长城景颐辰利债券 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     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去一个月      | 0. 26%   | 0. 05%      | 0. 66%     | 0. 09%        | -0. 40% | -0. 04% |
| 自基金合同生效起至今 | 0. 36%   | 0. 04%      | 0. 82%     | 0. 09%        | -0. 46% | -0. 05% |

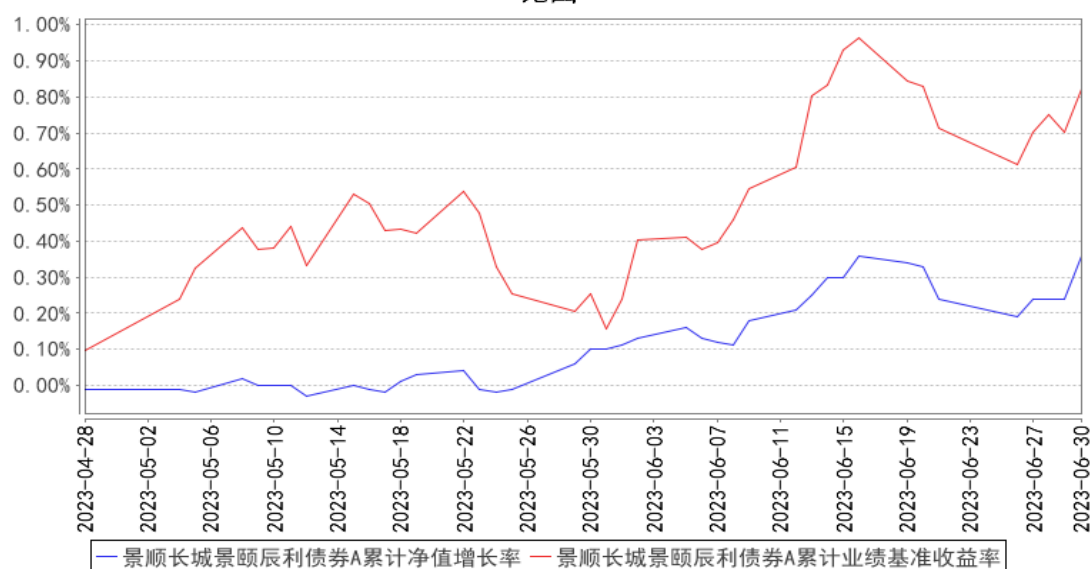
景顺长城景颐辰利债券 C

| 阶段 | 份额净 | 份额净值 | 业绩比较基 | 业绩比较基准 | ①－③ | ②－④ |
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|

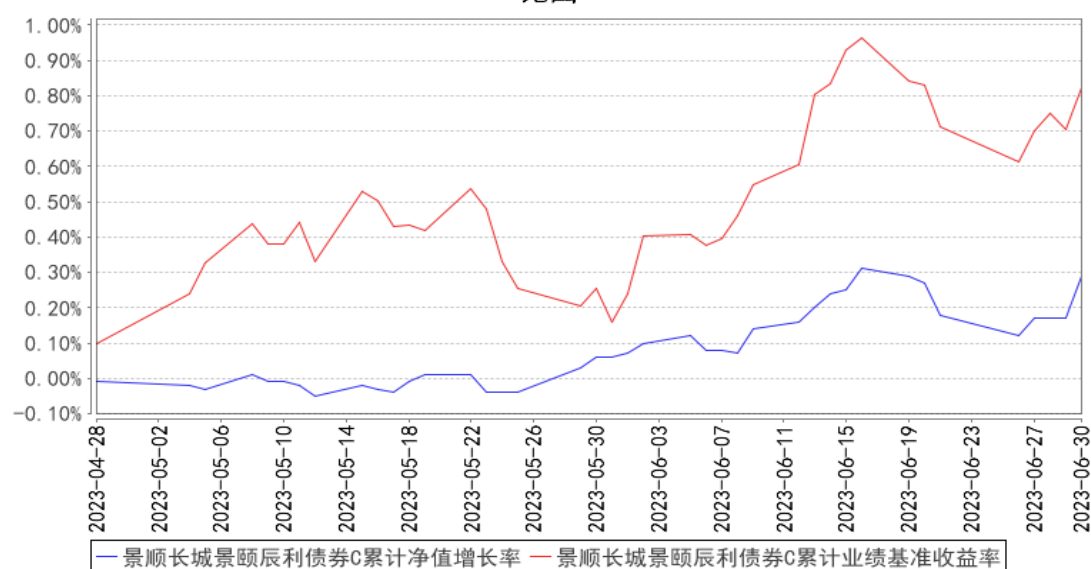
|                | 值增长率① | 增长率标准<br>差② | 准收益率③ | 收益率标准<br>差④ |        |        |
|----------------|-------|-------------|-------|-------------|--------|--------|
| 过去一个月          | 0.23% | 0.05%       | 0.66% | 0.09%       | -0.43% | -0.04% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 0.29% | 0.04%       | 0.82% | 0.09%       | -0.53% | -0.05% |

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

景顺长城景颐辰利债券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



景顺长城景颐辰利债券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



注：本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 4 月 28 日基金合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2023 年 4 月 28 日）起至本报告期末不满一年。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金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 2023 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 175 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 |        |                                                                                                                         |
| 陈莹 | 本基金的基金经理 | 2023 年 4 月 28 日 | -    | 9 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 9 年证券、基金行业从业经验。 |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------|

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《景顺长城景颐辰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 17 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

海外方面，上半年美国经济的韧性超出市场预期，虽然欧美在高通胀叠加货币政策快速紧缩的压力下隐现衰退风险，但美国经济在服务业支撑下，就业、消费等数据持续超市场预期，呈现

出较强的韧性，一定程度上弥补了美联储货币紧缩的压力。货币政策方面，美联储货币政策从“急加息”转为“观望期”。下半年来看，随着高利率环境的持续，以及信贷条件进一步收紧，依然制约美国经济的修复空间。不过因为美国积累的较高的超额储蓄尚未释放完全，以及服务业尚有一定修复空间，就业依然保持韧性，经济失速的风险不大。

国内方面，上半年经济整体前高后低，一季度经济有所反弹，随着补偿性需求释放完全，二季度经济修复程度略低于市场预期，社融增速下行，地产销售及投资数据持续低于市场预期，工业企业利润同比仍负增长，企业持续主动去库，生产走弱。

上半年，国内股票市场走势分化，上证指数上涨 3.65%，沪深 300 下跌 0.75%，创业板指下跌 5.61%，债市则走势偏强，1Y/3Y/5Y/10Y 国债分别下行 22BP/18BP/22BP/20BP。

景颐辰利于 4 月 28 日成立，五一之后开始逐步建仓，考虑到二季度股债市场波动均较大，且新组合没有收益的安全垫，我们控制了建仓的节奏。截至 6 月末，权益和债券部分仓位均较低。组合债券部分配置以利率债和高等级信用债为主，立足票息策略；权益部分配置整体较为均衡，结构上略向成长板块倾斜。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至本报告期末，景顺长城景颐辰利债券 A 份额净值增长率为 0.36%，业绩比较基准收益率为 0.82%。

2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至本报告期末，景顺长城景颐辰利债券 C 份额净值增长率为 0.29%，业绩比较基准收益率为 0.82%。

#### 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，海外方面，随着美联储货币紧缩的维持，以及信贷条件进一步收紧，依然制约美国经济基本面的修复空间。不过因为美国积累的较高的超额储蓄尚未释放完全，居民资产负债表较为健康，以及服务业尚有一定修复空间，就业依然保持韧性，经济失速的风险不大。国内方面，在二季度经济下行压力大幅释放过后，预计随着一批“稳增长”政策措施陆续落地，三季度经济基本面有望逐步企稳。在经济复苏初期，预计银行间流动性仍将继续维持合理充裕略宽松状态。地方政府方面，今年土地市场仍然萎靡，政府性基金收入持续负增长，城投企业债务压力较大。出口方面，虽然美国商品终端销售具有一定韧性，但是美国贸易商尚处于主动去库存阶段，叠加收紧的金融环境压制基本面的上行空间，预计短期内我国出口将继续承压。货币政策方面，5 月以来 DR007 周均值处于政策利率下方，6 月 13 日逆回购利率调降 10BP 至 1.9%，1 年 MLF 利率和 LPR 利率也随后下调。

债券市场方面，整体持中性的观点，在货币市场资金面相对中性偏松背景下，中短端品种确

定性仍相对较高，组合适当利用杠杆策略增厚收益。配置方向依然以高等级信用债为主，立足票息策略，同时积极把握一级市场放量和赎回等流动性冲击带来的银行次级债的投资机会。

权益市场方面，当前 A 股估值处于历史相对低位，结构性低估情况较为明显，同时货币政策相对友好，PPI 或将企稳，工业企业利润增速低位回升，股票市场具有较好配置价值，后续重点关注经济恢复情况。组合配置方向上，一方面，在中低估值的板块中寻找受益于稳增长、内需相关、景气度边际改善或者有预期差的行业；另一方面，择机增配上游品种（在海外黑天鹅事件冲击，上游资源品价格下跌的过程中），以及在细分行业中择机增配估值合理的具备中长期景气度的优质成长品种，重点关注未来竞争优势明显、景气程度可持续的高端制造业及受益于潜在政策支持的安全/自主可控领域等。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------|------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                        |
| 银行存款        | 6.4.7.1 | 718,783.15             |
| 结算备付金       |         | 11,832,475.61          |
| 存出保证金       |         | 4,468.50               |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 208,921,355.52         |
| 其中：股票投资     |         | 30,420,532.53          |
| 基金投资        |         | —                      |
| 债券投资        |         | 178,500,822.99         |

|               |            |                                |
|---------------|------------|--------------------------------|
| 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    | 423,941,492.39                 |
| 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         |            | 43,489.12                      |
| 应收股利          |            | -                              |
| 应收申购款         |            | -                              |
| 递延所得税资产       |            | -                              |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              |
| 资产总计          |            | 645,462,064.29                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023 年 6 月 30 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                |
| 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     |            | 21,746,391.51                  |
| 应付清算款         |            | 111,784.38                     |
| 应付赎回款         |            | -                              |
| 应付管理人报酬       |            | 357,960.45                     |
| 应付托管费         |            | 102,274.40                     |
| 应付销售服务费       |            | 108,898.62                     |
| 应付投资顾问费       |            | -                              |
| 应交税费          |            | 2,386.40                       |
| 应付利润          |            | -                              |
| 递延所得税负债       |            | -                              |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 86,975.94                      |
| 负债合计          |            | 22,516,671.70                  |
| <b>净资产：</b>   |            |                                |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 620,936,140.96                 |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                              |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 2,009,251.63                   |
| 净资产合计         |            | 622,945,392.59                 |
| 负债和净资产总计      |            | 645,462,064.29                 |

注：（1）报告截止日 2023 年 6 月 30 日，景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 1.0036 元，景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金 C 类基金份额净值人民币 1.0029 元，

基金份额总额 620,936,140.96 份，其中景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金 A 类基金份额 290,278,932.65 份；景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金 C 类基金份额 330,657,208.31 份。

(2) 本基金合同于 2023 年 4 月 28 日生效，本报实际编制期间为 2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                        | 附注号        | 本期<br>2023 年 4 月 28 日（基金合同<br>生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|------------|-----------------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>             |            | 3,255,204.05                                        |
| 1. 利息收入                    |            | 1,736,746.21                                        |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.13   | 58,837.58                                           |
| 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                 |            | 1,677,908.63                                        |
| 证券出借利息收入                   |            | -                                                   |
| 其他利息收入                     |            | -                                                   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 947,859.67                                          |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.14   | 349,646.35                                          |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.15   | -                                                   |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.16   | 351,212.26                                          |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.17   | -                                                   |
| 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   | 247,001.06                                          |
| 以摊余成本计量的金融资产<br>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“-”<br>号填列） | 6.4.7.21   | 570,598.17                                          |
| 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   | -                                                   |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 1,245,952.42                                        |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 750,936.60                                          |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 214,553.30                                          |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 228,469.00                                          |
| 4. 投资顾问费                   |            | -                                                   |
| 5. 利息支出                    |            | 5,908.90                                            |

|                            |          |                     |
|----------------------------|----------|---------------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 5,908.90            |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.24 | -                   |
| 7. 税金及附加                   |          | 365.33              |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.25 | 45,719.29           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>2,009,251.63</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>2,009,251.63</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | <b>-</b>            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>2,009,251.63</b> |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 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（基金净值）                     | -                                               | -      | -            | -              |
| 加：会计政策变更                            | -                                               | -      | -            | -              |
| 前期差错更正                              | -                                               | -      | -            | -              |
| 其他                                  | -                                               | -      | -            | -              |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                     | 620,936,140.96                                  | -      | -            | 620,936,140.96 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -                                               | -      | 2,009,251.63 | 2,009,251.63   |
| （一）、综合收益总额                          | -                                               | -      | 2,009,251.63 | 2,009,251.63   |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -                                               | -      | -            | -              |
| 其中：1. 基金申购款                         | -                                               | -      | -            | -              |
| 2. 基金赎回款                            | -                                               | -      | -            | -              |
| （三）、本期向基金份额持有人分                     | -                                               | -      | -            | -              |



|                           |                |   |              |                |
|---------------------------|----------------|---|--------------|----------------|
| 配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） |                |   |              |                |
| （四）、其他综合收益结转留存收益          | -              | - | -            | -              |
| 四、本期期末净资产（基金净值）           | 620,936,140.96 | - | 2,009,251.63 | 622,945,392.59 |

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

景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]552 号文《关于准予景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景颐辰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 4 月 28 日正式生效。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 620,791,860.04 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 144,280.92 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 620,936,140.96 元，折合 620,936,140.96 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金基金合同》和《景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用，且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费，而是从本类别基金资产净值中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

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：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。

本基金的业绩比较基准为：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%。

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 2023 年 8 月 28 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、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财

务状况以及自 2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）起至 2023 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

###### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，

同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入企业；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计

入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- （1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- （2）能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- （3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 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) 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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### (2) 增值税及附加

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计



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

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，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费附加。

### （3）企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

### （4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别

化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

#### (5) 境外投资

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 |
|-------------------|------------------------|
| 活期存款              | 718,783.15             |
| 等于：本金             | 718,721.84             |
| 加：应计利息            | 61.31                  |
| 减：坏账准备            | —                      |
| 定期存款              | —                      |
| 等于：本金             | —                      |
| 加：应计利息            | —                      |
| 减：坏账准备            | —                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内    | —                      |
| 存款期限 1 个月（含）-3 个月 | —                      |
| 其他存款              | —                      |
| 等于：本金             | —                      |
| 加：应计利息            | —                      |
| 减：坏账准备            | —                      |
| 合计                | 718,783.15             |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 |              |                |             |
|---------------|-------|------------------------|--------------|----------------|-------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动      |
| 股票            |       | 29,976,286.01          | —            | 30,420,532.53  | 444,246.52  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | —                      | —            | —              | —           |
| 债券            | 交易所市场 | 23,622,805.24          | 480,490.74   | 23,984,868.44  | -118,427.54 |
|               | 银行间市场 | 151,629,220.81         | 2,641,954.55 | 154,515,954.55 | 244,779.19  |

|        |    |                |              |                |            |
|--------|----|----------------|--------------|----------------|------------|
|        | 合计 | 175,252,026.05 | 3,122,445.29 | 178,500,822.99 | 126,351.65 |
| 资产支持证券 |    | -              | -            | -              | -          |
| 基金     |    | -              | -            | -              | -          |
| 其他     |    | -              | -            | -              | -          |
| 合计     |    | 205,228,312.06 | 3,122,445.29 | 208,921,355.52 | 570,598.17 |

### 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

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

#### 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<br>2023 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 203,285,744.68         | -         |
| 银行间市场 | 220,655,747.71         | -         |
| 合计    | 423,941,492.39         | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末的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

无。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 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

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 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<br>2023 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 45,266.18              |
| 其中：交易所市场    | 37,114.72              |
| 银行间市场       | 8,151.46               |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 41,709.76              |
| 合计          | 86,975.94              |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 景顺长城景颐辰利债券 A

| 项目            | 本期<br>2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|-------------------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                                         | 账面金额           |
| 基金合同生效日       | 290,278,932.65                                  | 290,278,932.65 |
| 本期申购          | -                                               | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                               | -              |
| 本期末           | 290,278,932.65                                  | 290,278,932.65 |

## 景顺长城景颐辰利债券 C

| 项目            | 本期<br>2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|-------------------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                                         | 账面金额           |
| 基金合同生效日       | 330,657,208.31                                  | 330,657,208.31 |
| 本期申购          | -                                               | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                               | -              |

|     |                |                |
|-----|----------------|----------------|
| 本期末 | 330,657,208.31 | 330,657,208.31 |
|-----|----------------|----------------|

注：（1）本基金合同于 2023 年 4 月 28 日生效。首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 620,791,860.04 元，折合 620,791,860.04 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 144,280.92 元，折合 144,280.92 份基金份额。其中 A 类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 290,219,008.26 元，折合 290,219,008.26 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 59,924.39 元，折合 59,924.39 份基金份额。C 类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币 330,572,851.78 元，折合 330,572,851.78 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 84,356.53 元，折合 84,356.53 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 620,936,140.96 元，折合 620,936,140.96 份基金份额。

（2）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

景顺长城景颐辰利债券 A

| 项目             | 已实现部分      | 未实现部分      | 未分配利润合计      |
|----------------|------------|------------|--------------|
| 基金合同生效日        | -          | -          | -            |
| 本期利润           | 779,538.43 | 266,822.77 | 1,046,361.20 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -          | -          | -            |
| 其中：基金申购款       | -          | -          | -            |
| 基金赎回款          | -          | -          | -            |
| 本期已分配利润        | -          | -          | -            |
| 本期末            | 779,538.43 | 266,822.77 | 1,046,361.20 |

景顺长城景颐辰利债券 C

| 项目             | 已实现部分      | 未实现部分      | 未分配利润合计    |
|----------------|------------|------------|------------|
| 基金合同生效日        | -          | -          | -          |
| 本期利润           | 659,115.03 | 303,775.40 | 962,890.43 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -          | -          | -          |
| 其中：基金申购款       | -          | -          | -          |
| 基金赎回款          | -          | -          | -          |
| 本期已分配利润        | -          | -          | -          |
| 本期末            | 659,115.03 | 303,775.40 | 962,890.43 |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------|-------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 47,122.51                                       |
| 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 | 11,709.45                                       |
| 其他        | 5.62                                            |
| 合计        | 58,837.58                                       |

#### 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<br>2023年4月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
|------------------|--------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 349,646.35                           |
| 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               | 349,646.35                           |

##### 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<br>2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------|-------------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 5,135,428.34                                    |
| 减：卖出股票成本总额 | 4,740,395.00                                    |
| 减：交易费用     | 45,386.99                                       |
| 买卖股票差价收入   | 349,646.35                                      |

##### 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

无。

#### 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<br>2023年4月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
|--------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 346,843.11                           |

|                              |            |
|------------------------------|------------|
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 4,369.15   |
| 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                           | 351,212.26 |

#### 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<br>2023年4月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
|------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 428,544.33                           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 421,932.35                           |
| 减：应计利息总额               | 428.80                               |
| 减：交易费用                 | 1,814.03                             |
| 买卖债券差价收入               | 4,369.15                             |

#### 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 |
|----|----|
|----|----|

|               | 2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------------|-------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 247,001.06                                |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                         |
| 基金投资产生的股利收益   | -                                         |
| 合计            | 247,001.06                                |

#### 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------|-------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 570,598.17                                      |
| 股票投资                   | 444,246.52                                      |
| 债券投资                   | 126,351.65                                      |
| 资产支持证券投资               | -                                               |
| 基金投资                   | -                                               |
| 贵金属投资                  | -                                               |
| 其他                     | -                                               |
| 2. 衍生工具                | -                                               |
| 权证投资                   | -                                               |
| 3. 其他                  | -                                               |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                                               |
| 合计                     | 570,598.17                                      |

#### 6.4.7.22 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.23 持有基金产生的费用

本基金无持有基金产生的费用。

#### 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<br>2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------|-------------------------------------------------|
| 审计费用      | 15,484.16                                       |
| 信息披露费     | 23,225.60                                       |
| 证券出借违约金   | -                                               |
| 债券托管账户维护费 | 3,000.00                                        |
| 银行划款手续费   | 3,249.53                                        |



|    |           |
|----|-----------|
| 其他 | 760.00    |
| 合计 | 45,719.29 |

#### 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，本基金无需作披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系           |
|------------------------|-------------------|
| 景顺长城基金管理有限公司           | 基金管理人、登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 基金托管人、基金销售机构      |
| 长城证券股份有限公司（“长城证券”）     | 基金管理人的股东、基金销售机构   |
| 大连实德集团有限公司             | 基金管理人的股东          |
| 景顺资产管理有限公司             | 基金管理人的股东          |
| 开滦(集团)有限责任公司           | 基金管理人的股东          |
| 景顺长城资产管理(深圳)有限公司       | 基金管理人的子公司         |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |                     |
|-------|-------------------------------------------------|---------------------|
|       | 成交金额                                            | 占当期股票<br>成交总额的比例（%） |
| 长城证券  | 1,105,704.40                                    | 2.77                |

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年4月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |                   |          |                     |
|-------|--------------------------------------|-------------------|----------|---------------------|
|       | 当期<br>佣金                             | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |

|      |          |      |          |      |
|------|----------|------|----------|------|
| 长城证券 | 1,029.75 | 2.77 | 1,029.75 | 2.77 |
|------|----------|------|----------|------|

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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                                        |
|-----------------|-------------------------------------------|
|                 | 2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 750,936.60                                |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 370,542.27                                |

注：基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除所持有本基金管理人管理的基金的基金份额的资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                                        |
|----------------|-------------------------------------------|
|                | 2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 214,553.30                                |

注：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除所持有基金托管人托管的基金的基金份额的资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0

##### 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                                        |
|----------------|-------------------------------------------|
|                | 2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                          |

|              | 景顺长城景颐辰利债券<br>A | 景顺长城景颐辰利债券<br>C | 合计         |
|--------------|-----------------|-----------------|------------|
| 景顺长城基金管理有限公司 | —               | —               | —          |
| 建设银行         | —               | 227,517.16      | 227,517.16 |
| 长城证券         | —               | —               | —          |
| 合计           | —               | 227,517.16      | 227,517.16 |

注：基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未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

本基金本报告期末未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末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<br>2023 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |        |
|-------|-------------------------------------------------|--------|
|       | 期末余额                                            | 当期利息收入 |
|       |                                                 |        |

|           |            |           |
|-----------|------------|-----------|
| 中国建设银行-活期 | 718,783.15 | 47,122.51 |
|-----------|------------|-----------|

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，并按银行间同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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

无。

##### 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

本基金无当期交易及持有基金产生的费用。

#### 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（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 20,996,322.25 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        |
|--------|----------|----------------|--------|---------|---------------|
| 230301 | 23 进出 01 | 2023 年 7 月 3 日 | 100.95 | 221,000 | 22,310,239.83 |
| 合计     |          |                |        | 221,000 | 22,310,239.83 |

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 750,069.26 元，于 2023 年 7 月 4 日前（含当日）先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

## 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同责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 21.83%。

### 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 个工作日内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 个工作日内可变现资产的可变现价值。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023<br>年6<br>月30<br>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                            |                |              |               |               |               |               |                |
| 银行存款                          | 718,783.15     | -            | -             | -             | -             | -             | 718,783.15     |
| 结算备付金                         | 11,832,475.61  | -            | -             | -             | -             | -             | 11,832,475.61  |
| 存出保证金                         | 4,468.50       | -            | -             | -             | -             | -             | 4,468.50       |
| 交易性金融资产                       | 31,079,842.19  | 2,074,226.30 | 30,285,393.44 | 31,227,269.97 | 83,834,091.09 | 30,420,532.53 | 208,921,355.52 |
| 买入返售金融资产                      | 423,941,492.39 | -            | -             | -             | -             | -             | 423,941,492.39 |
| 应收证券清算                        | -              | -            | -             | -             | -             | 43,489.12     | 43,489.12      |

|           |                |               |               |               |               |               |                |
|-----------|----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
| 款         |                |               |               |               |               |               |                |
| 资产总计      | 467,577,061.84 | 42,074,226.30 | 30,285,393.44 | 31,227,269.97 | 83,834,091.09 | 30,464,021.65 | 645,462,064.29 |
| 负债        |                |               |               |               |               |               |                |
| 应付管理人报酬   | -              | -             | -             | -             | -             | 357,960.45    | 357,960.45     |
| 应付托管费     | -              | -             | -             | -             | -             | 102,274.40    | 102,274.40     |
| 应付证券清算款   | -              | -             | -             | -             | -             | 111,784.38    | 111,784.38     |
| 卖出回购金融资产款 | 21,746,391.51  | -             | -             | -             | -             | -             | 21,746,391.51  |
| 应付销售服务费   | -              | -             | -             | -             | -             | 108,898.62    | 108,898.62     |
| 应交税费      | -              | -             | -             | -             | -             | 2,386.40      | 2,386.40       |
| 其他负债      | -              | -             | -             | -             | -             | 86,975.94     | 86,975.94      |
| 负债总计      | 21,746,391.51  | -             | -             | -             | -             | 770,280.19    | 22,516,671.70  |
| 利率敏感度缺口   | 445,830,670.33 | 42,074,226.30 | 30,285,393.44 | 31,227,269.97 | 83,834,091.09 | -             | -              |

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（2023年6月30日）             |
|    | 市场利率上升25个基点        | -634,757.91                 |



|  |               |            |
|--|---------------|------------|
|  | 市场利率下降 25 个基点 | 639,935.78 |
|--|---------------|------------|

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 |               |
|---------------|------------------------|---------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 30,420,532.53          | 4.88          |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | —             |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | —                      | —             |
| 衍生金融资产—权证投资   | —                      | —             |
| 其他            | —                      | —             |
| 合计            | 30,420,532.53          | 4.88          |

##### 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（2023 年 6 月 30 日）        |
|    | 沪深 300 指数上升 5%          | 1,104,091.87                |
|    | 沪深 300 指数下降             | -1,104,091.87               |

5%

#### 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<br>2023 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次          | 31,784,711.66          |
| 第二层次          | 177,136,643.86         |
| 第三层次          | —                      |
| 合计            | 208,921,355.52         |

###### 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、基金等投资，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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 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              | 30,420,532.53  | 4.71          |
|    | 其中：股票             | 30,420,532.53  | 4.71          |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 178,500,822.99 | 27.65         |
|    | 其中：债券             | 178,500,822.99 | 27.65         |
|    | 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          | 423,941,492.39 | 65.68         |
|    | 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      | 12,551,258.76  | 1.94          |
| 8  | 其他各项资产            | 47,957.62      | 0.01          |
| 9  | 合计                | 645,462,064.29 | 100.00        |

注：报告期末，本基金处于建仓期，基金管理人将在合同规定期限内对投资组合比例进行调整以符合法律法规及基金合同的相关规定。

### 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         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | 3,722,475.00  | 0.60          |
| C  | 制造业              | 20,333,187.45 | 3.26          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 558,792.00    | 0.09          |
| E  | 建筑业              | 907,938.00    | 0.15          |
| F  | 批发和零售业           | 527,681.00    | 0.08          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 474,183.00    | 0.08          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,787,001.08  | 0.29          |
| J  | 金融业              | 1,572,445.00  | 0.25          |
| K  | 房地产业             | 93,492.00     | 0.02          |
| 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            | 241,499.00    | 0.04 |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 201,839.00    | 0.03 |
| S | 综合            | -             | -    |
|   | 合计            | 30,420,532.53 | 4.88 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 300037 | 新宙邦  | 28,600  | 1,484,054.00 | 0.24         |
| 2  | 600938 | 中国海油 | 57,900  | 1,049,148.00 | 0.17         |
| 3  | 688012 | 中微公司 | 6,561   | 1,026,468.45 | 0.16         |
| 4  | 601857 | 中国石油 | 134,400 | 1,003,968.00 | 0.16         |
| 5  | 002463 | 沪电股份 | 42,600  | 892,044.00   | 0.14         |
| 6  | 601128 | 常熟银行 | 107,800 | 735,196.00   | 0.12         |
| 7  | 002371 | 北方华创 | 2,300   | 730,595.00   | 0.12         |
| 8  | 688019 | 安集科技 | 4,346   | 716,351.18   | 0.11         |
| 9  | 601899 | 紫金矿业 | 60,600  | 689,022.00   | 0.11         |
| 10 | 000568 | 泸州老窖 | 3,200   | 670,624.00   | 0.11         |
| 11 | 601138 | 工业富联 | 26,000  | 655,200.00   | 0.11         |
| 12 | 300567 | 精测电子 | 6,800   | 647,020.00   | 0.10         |
| 13 | 002409 | 雅克科技 | 8,700   | 634,056.00   | 0.10         |
| 14 | 002436 | 兴森科技 | 40,300  | 624,650.00   | 0.10         |
| 15 | 601208 | 东材科技 | 47,800  | 607,060.00   | 0.10         |
| 16 | 002709 | 天赐材料 | 14,500  | 597,255.00   | 0.10         |
| 17 | 600941 | 中国移动 | 6,400   | 597,120.00   | 0.10         |
| 18 | 002126 | 银轮股份 | 33,400  | 591,180.00   | 0.09         |
| 19 | 600267 | 海正药业 | 50,900  | 579,242.00   | 0.09         |
| 20 | 000938 | 紫光股份 | 18,100  | 576,485.00   | 0.09         |
| 21 | 000690 | 宝新能源 | 79,600  | 558,792.00   | 0.09         |
| 22 | 000028 | 国药一致 | 12,100  | 527,681.00   | 0.08         |
| 23 | 000999 | 华润三九 | 8,600   | 521,676.00   | 0.08         |
| 24 | 688106 | 金宏气体 | 19,124  | 520,172.80   | 0.08         |
| 25 | 002912 | 中新赛克 | 11,700  | 514,917.00   | 0.08         |
| 26 | 601390 | 中国中铁 | 67,000  | 507,860.00   | 0.08         |
| 27 | 002156 | 通富微电 | 22,300  | 503,980.00   | 0.08         |
| 28 | 300750 | 宁德时代 | 2,200   | 503,338.00   | 0.08         |
| 29 | 600988 | 赤峰黄金 | 37,300  | 502,058.00   | 0.08         |

|    |        |        |        |            |      |
|----|--------|--------|--------|------------|------|
| 30 | 688276 | 百克生物   | 8,010  | 501,426.00 | 0.08 |
| 31 | 000596 | 古井贡酒   | 2,000  | 494,760.00 | 0.08 |
| 32 | 601600 | 中国铝业   | 89,600 | 491,904.00 | 0.08 |
| 33 | 600489 | 中金黄金   | 46,300 | 478,279.00 | 0.08 |
| 34 | 000858 | 五 粮 液  | 2,900  | 474,353.00 | 0.08 |
| 35 | 600761 | 安徽合力   | 23,300 | 464,369.00 | 0.07 |
| 36 | 688111 | 金山办公   | 964    | 455,220.08 | 0.07 |
| 37 | 688766 | 普冉股份   | 3,971  | 424,182.22 | 0.07 |
| 38 | 603931 | 格林达    | 13,400 | 408,030.00 | 0.07 |
| 39 | 601668 | 中国建筑   | 69,700 | 400,078.00 | 0.06 |
| 40 | 600732 | 爱旭股份   | 12,180 | 374,535.00 | 0.06 |
| 41 | 688008 | 澜起科技   | 5,995  | 344,232.90 | 0.06 |
| 42 | 688378 | 奥来德    | 6,739  | 332,906.60 | 0.05 |
| 43 | 688110 | 东芯股份   | 8,613  | 310,929.30 | 0.05 |
| 44 | 603855 | 华荣股份   | 11,500 | 305,900.00 | 0.05 |
| 45 | 603885 | 吉祥航空   | 16,900 | 260,767.00 | 0.04 |
| 46 | 000733 | 振华科技   | 2,700  | 258,795.00 | 0.04 |
| 47 | 000933 | 神火股份   | 19,800 | 257,400.00 | 0.04 |
| 48 | 000630 | 铜陵有色   | 88,800 | 256,632.00 | 0.04 |
| 49 | 605098 | 行动教育   | 6,100  | 241,499.00 | 0.04 |
| 50 | 601398 | 工商银行   | 49,500 | 238,590.00 | 0.04 |
| 51 | 002129 | TCL 中环 | 7,100  | 235,720.00 | 0.04 |
| 52 | 603986 | 兆易创新   | 2,200  | 233,750.00 | 0.04 |
| 53 | 601988 | 中国银行   | 59,300 | 231,863.00 | 0.04 |
| 54 | 002254 | 泰和新材   | 9,300  | 227,571.00 | 0.04 |
| 55 | 002555 | 三七互娱   | 6,300  | 219,744.00 | 0.04 |
| 56 | 601111 | 中国国航   | 25,900 | 213,416.00 | 0.03 |
| 57 | 300413 | 芒果超媒   | 5,900  | 201,839.00 | 0.03 |
| 58 | 002318 | 久立特材   | 11,600 | 197,548.00 | 0.03 |
| 59 | 600309 | 万华化学   | 2,200  | 193,248.00 | 0.03 |
| 60 | 300054 | 鼎龙股份   | 7,800  | 192,894.00 | 0.03 |
| 61 | 601077 | 渝农商行   | 51,200 | 183,808.00 | 0.03 |
| 62 | 601377 | 兴业证券   | 29,900 | 182,988.00 | 0.03 |
| 63 | 000063 | 中兴通讯   | 2,600  | 118,404.00 | 0.02 |
| 64 | 002182 | 云海金属   | 4,900  | 107,751.00 | 0.02 |
| 65 | 002244 | 滨江集团   | 10,600 | 93,492.00  | 0.02 |
| 66 | 300896 | 爱美客    | 100    | 44,495.00  | 0.01 |

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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     | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 300037 | 新宙邦  | 1,377,876.40 | 0.22           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 2  | 600938 | 中国海油 | 1,077,865.00 | 0.17 |
| 3  | 688012 | 中微公司 | 1,075,298.11 | 0.17 |
| 4  | 601857 | 中国石油 | 1,008,204.00 | 0.16 |
| 5  | 002463 | 沪电股份 | 951,148.60   | 0.15 |
| 6  | 688019 | 安集科技 | 822,877.40   | 0.13 |
| 7  | 600941 | 中国移动 | 810,415.00   | 0.13 |
| 8  | 601128 | 常熟银行 | 803,302.00   | 0.13 |
| 9  | 002371 | 北方华创 | 735,047.00   | 0.12 |
| 10 | 000568 | 泸州老窖 | 687,556.00   | 0.11 |
| 11 | 601899 | 紫金矿业 | 674,250.00   | 0.11 |
| 12 | 600267 | 海正药业 | 658,513.00   | 0.11 |
| 13 | 300567 | 精测电子 | 641,489.00   | 0.10 |
| 14 | 600761 | 安徽合力 | 638,162.00   | 0.10 |
| 15 | 601208 | 东材科技 | 633,482.00   | 0.10 |
| 16 | 603931 | 格林达  | 633,436.00   | 0.10 |
| 17 | 002709 | 天赐材料 | 631,460.00   | 0.10 |
| 18 | 688378 | 奥来德  | 620,831.98   | 0.10 |
| 19 | 688111 | 金山办公 | 620,638.41   | 0.10 |
| 20 | 605098 | 行动教育 | 620,505.00   | 0.10 |

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末基金资产净值 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   | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|------------|----------------|
| 1  | 605098 | 行动教育   | 486,067.00 | 0.08           |
| 2  | 688378 | 奥来德    | 413,439.75 | 0.07           |
| 3  | 301018 | 申菱环境   | 389,194.00 | 0.06           |
| 4  | 603801 | 志邦家居   | 312,482.00 | 0.05           |
| 5  | 601882 | 海天精工   | 296,821.00 | 0.05           |
| 6  | 688311 | 盟升电子   | 272,307.38 | 0.04           |
| 7  | 603931 | 格林达    | 250,322.00 | 0.04           |
| 8  | 688111 | 金山办公   | 250,195.49 | 0.04           |
| 9  | 600761 | 安徽合力   | 235,721.00 | 0.04           |
| 10 | 000951 | 中国重汽   | 226,621.00 | 0.04           |
| 11 | 002129 | TCL 中环 | 225,836.00 | 0.04           |
| 12 | 600941 | 中国移动   | 218,601.00 | 0.04           |
| 13 | 003035 | 南网能源   | 201,991.00 | 0.03           |
| 14 | 002126 | 银轮股份   | 200,327.00 | 0.03           |
| 15 | 002318 | 久立特材   | 166,047.72 | 0.03           |
| 16 | 601138 | 工业富联   | 115,177.00 | 0.02           |
| 17 | 002555 | 三七互娱   | 103,866.00 | 0.02           |
| 18 | 300274 | 阳光电源   | 102,868.00 | 0.02           |
| 19 | 603986 | 兆易创新   | 101,047.00 | 0.02           |

|    |        |      |           |      |
|----|--------|------|-----------|------|
| 20 | 002244 | 滨江集团 | 97,413.00 | 0.02 |
|----|--------|------|-----------|------|

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 | 34,716,681.01 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 5,135,428.34  |

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      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 125,510,338.66 | 20.15        |
|    | 其中：政策性金融债 | 42,539,959.47  | 6.83         |
| 4  | 企业债券      | 20,546,463.01  | 3.30         |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 31,079,842.19  | 4.99         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,364,179.13   | 0.22         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 178,500,822.99 | 28.65        |

#### 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  | 101661025 | 16 皖交控 MTN002B | 300,000 | 31,079,842.19 | 4.99         |
| 2  | 230301    | 23 进出 01       | 300,000 | 30,285,393.44 | 4.86         |
| 3  | 1920059   | 19 江苏银行二级      | 200,000 | 20,997,555.07 | 3.37         |
| 4  | 1920066   | 19 上海银行二级      | 200,000 | 20,923,267.95 | 3.36         |
| 5  | 2228003   | 22 兴业银行二级 01   | 200,000 | 20,502,071.23 | 3.29         |

#### 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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

（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，本基金会面临亏损风险。

#### 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

#### 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

江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局的处罚。

兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会及其分支机构的处罚。

深圳新宙邦科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国浦东海事局的处罚。

江苏常熟农村商业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南京分行的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

##### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

##### 7.12.3 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 | 4,468.50  |
| 2  | 应收清算款 | 43,489.12 |
| 3  | 应收股利  | —         |
| 4  | 应收利息  | —         |
| 5  | 应收申购款 | —         |
| 6  | 其他应收款 | —         |

|   |      |           |
|---|------|-----------|
| 7 | 待摊费用 | -         |
| 8 | 其他   | -         |
| 9 | 合计   | 47,957.62 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 113062 | 常银转债 | 863,711.90 | 0.14         |
| 2  | 110059 | 浦发转债 | 500,467.23 | 0.08         |

#### 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（%） |
| 景顺长城景颐辰利债券 A | 895      | 324,334.00 | 9,999,000.00  | 3.44      | 280,279,932.65 | 96.56     |
| 景顺长城景颐辰利债券 C | 762      | 433,933.34 | 10,004,000.00 | 3.03      | 320,653,208.31 | 96.97     |
| 合计           | 1,657    | 374,735.15 | 20,003,000.00 | 3.22      | 600,933,140.96 | 96.78     |

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 | 景顺长城景颐辰利债券 A | 21.89     | 0.000008    |
|              | 景顺长城景颐辰利债券 C | 13,021.22 | 0.003938    |

|      |    |           |          |
|------|----|-----------|----------|
| 有本基金 |    |           |          |
|      | 合计 | 13,043.11 | 0.002101 |

### 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

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 景顺长城景颐辰利债券 A   | 景顺长城景颐辰利债券 C   |
|----------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日<br>(2023 年 4 月 28 日)<br>基金份额总额 | 290,278,932.65 | 330,657,208.31 |
| 基金合同生效日起至<br>报告期期末基金总申<br>购份额          | —              | —              |
| 减：基金合同生效日<br>起至报告期期末基金<br>总赎回份额        | —              | —              |
| 基金合同生效日起至<br>报告期期末基金拆分<br>变动份额         | —              | —              |
| 本报告期期末基金份<br>额总额                       | 290,278,932.65 | 330,657,208.31 |

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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

**10.5 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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况****10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

**10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

**10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称           | 交易单元<br>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<br>成交总额的<br>比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金<br>总量的比例<br>(%) |    |
| 光大证券<br>股份有限公司 | 2          | 10,082,391.97 | 25.30                    | 9,389.68  | 25.30                 | -  |
| 长江证券<br>股份有限公司 | 1          | 5,760,279.16  | 14.45                    | 5,364.48  | 14.45                 | -  |
| 华创证券<br>有限责任公司 | 1          | 4,397,281.13  | 11.03                    | 4,095.47  | 11.03                 | -  |
| 国信证券<br>股份有限公司 | 2          | 4,239,270.07  | 10.64                    | 3,948.10  | 10.64                 | -  |
| 安信证券<br>股份有限公司 | 1          | 3,195,956.00  | 8.02                     | 2,976.21  | 8.02                  | -  |
| 渤海证券<br>股份有限公司 | 1          | 3,088,253.00  | 7.75                     | 2,876.10  | 7.75                  | -  |
| 天风证券           | 1          | 1,958,922.70  | 4.92                     | 1,824.65  | 4.92                  | -  |

|              |   |              |      |          |      |   |
|--------------|---|--------------|------|----------|------|---|
| 股份有限公司       |   |              |      |          |      |   |
| 中信建投证券股份有限公司 | 2 | 1,726,111.00 | 4.33 | 1,607.47 | 4.33 | - |
| 东方证券股份有限公司   | 1 | 1,313,564.00 | 3.30 | 1,223.45 | 3.30 | - |
| 长城证券股份有限公司   | 2 | 1,105,704.40 | 2.77 | 1,029.75 | 2.77 | - |
| 中泰证券股份有限公司   | 2 | 931,167.00   | 2.34 | 867.21   | 2.34 | - |
| 东方财富证券股份有限公司 | 2 | 907,470.57   | 2.28 | 845.28   | 2.28 | - |
| 东北证券股份有限公司   | 1 | 861,688.21   | 2.16 | 802.33   | 2.16 | - |
| 西部证券股份有限公司   | 2 | 284,050.14   | 0.71 | 264.54   | 0.71 | - |
| 方正证券股份有限公司   | 1 | -            | -    | -        | -    | - |
| 广发证券股份有限公司   | 1 | -            | -    | -        | -    | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1 | -            | -    | -        | -    | - |
| 华金证券股份有限公司   | 2 | -            | -    | -        | -    | - |
| 汇丰前海证券有限责任公司 | 1 | -            | -    | -        | -    | - |
| 招商证券股份有限公司   | 1 | -            | -    | -        | -    | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | 1 | -            | -    | -        | -    | - |

|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 中信证券股份有限公司   | 4 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

a、资金实力雄厚，信誉良好；

b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；

d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；

e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

2、本基金与景顺长城优质成长股票型证券投资基金共用交易单元。

### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 债券交易 |                  | 债券回购交易         |                    | 权证交易 |                  | 基金交易 |                  |
|------------|------|------------------|----------------|--------------------|------|------------------|------|------------------|
|            | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额           | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 (%) |
| 光大证券股份有限公司 | -    | -                | 913,148,000.00 | 26.78              | -    | -                | -    | -                |
| 长江证券       | -    | -                | 69,010,000.00  | 2.02               | -    | -                | -    | -                |

|              |               |       |                |       |   |   |   |   |
|--------------|---------------|-------|----------------|-------|---|---|---|---|
| 股份有限公司       |               |       |                |       |   |   |   |   |
| 华创证券有限责任公司   | 3,330,927.48  | 13.61 | 641,120,000.00 | 18.80 | - | - | - | - |
| 国信证券股份有限公司   | 20,254,711.51 | 82.74 | 583,677,000.00 | 17.11 | - | - | - | - |
| 安信证券股份有限公司   | -             | -     | 53,086,000.00  | 1.56  | - | - | - | - |
| 渤海证券股份有限公司   | -             | -     | 219,343,000.00 | 6.43  | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司   | 212,518.89    | 0.87  | 332,550,000.00 | 9.75  | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | -             | -     | 201,900,000.00 | 5.92  | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司   | -             | -     | 61,000,000.00  | 1.79  | - | - | - | - |
| 长城证券股份有限公司   | 68,858.86     | 0.28  | 7,410,000.00   | 0.22  | - | - | - | - |

|                                  |            |      |                |      |   |   |   |   |
|----------------------------------|------------|------|----------------|------|---|---|---|---|
| 中泰<br>证券<br>股份<br>有限<br>公司       | -          | -    | 111,830,000.00 | 3.28 | - | - | - | - |
| 东方<br>财富<br>证券<br>股份<br>有限<br>公司 | 313,337.96 | 1.28 | 207,320,000.00 | 6.08 | - | - | - | - |
| 东北<br>证券<br>股份<br>有限<br>公司       | -          | -    | 1,365,000.00   | 0.04 | - | - | - | - |
| 西部<br>证券<br>股份<br>有限<br>公司       | 299,335.71 | 1.22 | 7,640,000.00   | 0.22 | - | - | - | - |
| 方正<br>证券<br>股份<br>有限<br>公司       | -          | -    | -              | -    | - | - | - | - |
| 广发<br>证券<br>股份<br>有限<br>公司       | -          | -    | -              | -    | - | - | - | - |
| 国泰<br>君安<br>证券<br>股份<br>有限<br>公司 | -          | -    | -              | -    | - | - | - | - |
| 华金<br>证券<br>股份<br>有限<br>公司       | -          | -    | -              | -    | - | - | - | - |
| 汇丰<br>前海<br>证券                   | -          | -    | -              | -    | - | - | - | - |



|                                  |   |   |   |   |   |   |   |   |
|----------------------------------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 有限<br>责任<br>公司                   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| 招商<br>证券<br>股份<br>有限<br>公司       | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中国<br>国际<br>金融<br>股份<br>有限<br>公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信<br>证券<br>股份<br>有限<br>公司       | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中银<br>国际<br>证券<br>股份<br>有限<br>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系统停机维护的公告          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 2 月 10 日 |
| 2  | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 2 月 24 日 |
| 3  | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 3 月 25 日 |
| 4  | 景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金基金产品资料概要        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 7 日  |
| 5  | 景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 7 日  |
| 6  | 景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金招募说明书           | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 7 日  |
| 7  | 景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金基金份额发售公告        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 7 日  |
| 8  | 景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金托管协议            | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 7 日  |
| 9  | 景顺长城景颐辰利债券型证券投资基                 | 中国证监会指定报刊及   | 2023 年 4 月 7 日  |

|    |                                                                |              |                 |
|----|----------------------------------------------------------------|--------------|-----------------|
|    | 金基金合同                                                          | 网站           |                 |
| 10 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                                        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 8 日  |
| 11 | 景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金新增腾安基金为销售机构的公告                                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 10 日 |
| 12 | 景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金新增广发银行等多家公司为销售机构的公告                           | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 13 日 |
| 13 | 景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金新增上海浦东发展银行为销售机构的公告                            | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 14 日 |
| 14 | 景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金新增上海农商行为销售机构的公告                               | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 17 日 |
| 15 | 景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示                                    | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 18 日 |
| 16 | 景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金新增平安银行为销售机构的公告                                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 19 日 |
| 17 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                                        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 22 日 |
| 18 | 景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金新增国元证券为销售机构的公告                                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 26 日 |
| 19 | 关于景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金提前结束募集的公告                                   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 26 日 |
| 20 | 关于景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金基金合同生效的公告                                   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 29 日 |
| 21 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                                        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 6 日  |
| 22 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                                        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 13 日 |
| 23 | 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 | 2023 年 5 月 23 日 |
| 24 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                                        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 27 日 |
| 25 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                                        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 10 日 |
| 26 | 关于旗下部分基金新增中国人寿为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 12 日 |
| 27 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                                        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 17 日 |
| 28 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                                        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 22 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

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

2023 年 8 月 30 日