

# 景顺长城景颐辰利债券型证券投资基金 2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 07 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。  
本报告期自 2026 年 04 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 景顺长城景颐辰利债券                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 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                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 报告期末基金份额总额 | 294,368,788.41 份                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 投资目标       | 本基金主要通过投资于固定收益类资产获得稳健收益，同时适当投资于具备良好盈利能力的上市公司所发行的股票，在严格控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。                                                                                                                                                                                                       |
| 投资策略       | 1、资产配置策略<br>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。<br>2、债券投资策略<br>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。<br>3、股票投资策略<br>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。<br>4、国债期货投资策略 |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                 |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
|                 | <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）。</p> <p>6、信用衍生品投资策略</p> <p>本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。</p> |                 |
| 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          | <p>本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。</p> <p>本基金还可能投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>                                                                                                                                                               |                 |
| 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                 |
| 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 | 207,731,352.82 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 86,637,435.59 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日） |               |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
|                 | 景顺长城景颐辰利债券 A                        | 景顺长城景颐辰利债券 C  |
| 1. 本期已实现收益      | -3,957,382.06                       | -3,206,824.26 |
| 2. 本期利润         | 10,539.98                           | 297,752.07    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0000                              | 0.0011        |
| 4. 期末基金资产净值     | 223,641,508.46                      | 92,077,860.69 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0765                              | 1.0627        |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城景颐辰利债券 A

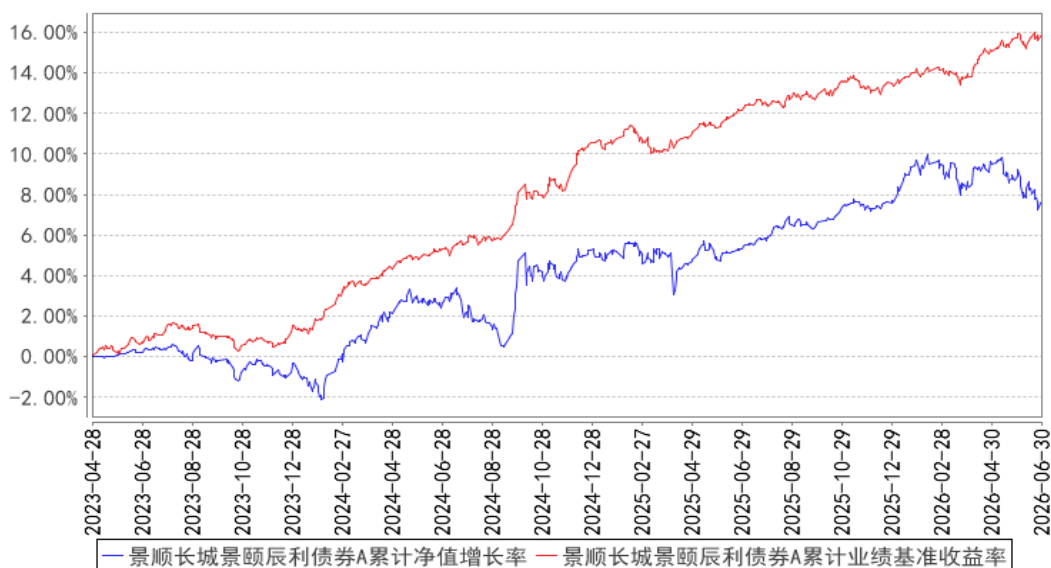
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | -0.52% | 0.24%     | 1.83%      | 0.13%         | -2.35% | 0.11% |
| 过去六个月      | 0.01%  | 0.23%     | 2.17%      | 0.12%         | -2.16% | 0.11% |
| 过去一年       | 2.19%  | 0.17%     | 3.32%      | 0.11%         | -1.13% | 0.06% |
| 过去三年       | 7.26%  | 0.21%     | 14.90%     | 0.11%         | -7.64% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.65%  | 0.20%     | 15.84%     | 0.11%         | -8.19% | 0.09% |

景顺长城景颐辰利债券 C

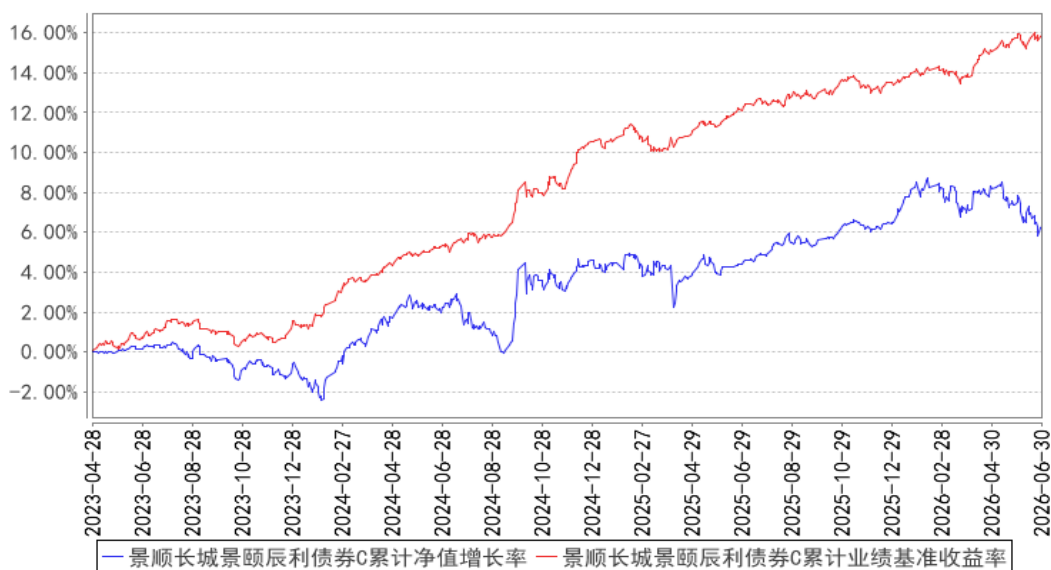
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | -0.62% | 0.24%     | 1.83%      | 0.13%         | -2.45% | 0.11% |
| 过去六个月      | -0.19% | 0.23%     | 2.17%      | 0.12%         | -2.36% | 0.11% |
| 过去一年       | 1.77%  | 0.17%     | 3.32%      | 0.11%         | -1.55% | 0.06% |
| 过去三年       | 5.96%  | 0.21%     | 14.90%     | 0.11%         | -8.94% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.27%  | 0.20%     | 15.84%     | 0.11%         | -9.57% | 0.09% |

#### 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。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 |        |                                                                                                                     |
| 李训练 | 本基金的基金经理 | 2025 年 6 月 19 日 | —    | 9 年    | 管理学硕士，FRM。曾任长城基金固定收益部研究员、固定收益投资部投资经理。2022 年 9 月加入本公司，自 2023 年 3 月起开始担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。                |
| 张飞鹏 | 本基金的基金经理 | 2026 年 1 月 20 日 | —    | 9 年    | 金融硕士。曾任上海理成资产管理有限公司研究部研究员，东吴证券股份有限公司研究所研究员。2021 年 9 月加入本公司，历任研究部研究员、基金经理助理，2024 年 11 月起担任研究部基金经理。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”为公司决定且公告的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”及“离任日期”指根据公司决定且公告的聘任、解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

无。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城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 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《证券投资基金管理人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

2026 年二季度，内需全面走弱，外需强劲。投资方面，5 月制造业投资、基建、房地产全面下滑，内需偏弱，财政支出收缩。外需保持强劲，AI 产业链出口是核心驱动，量价拆分显示价格贡献远大于数量贡献，对生产端拉动效果有限，二季度 GDP 读数面临下行压力。价格方面，虽然 5 月 PPI 同比涨幅扩大，但涨价集中于上游采掘和原材料，下游生活资料价格环比持平，上下游传导仍然困难。

展望未来，出口韧性持续，面对二季度内需加速下滑，增量政策加码必要性加强，推动超长期特别国债和专项债加快发行使用，并推动政策性金融工具加快落地，消费仍受居民就业和预期偏弱制约，预计维持低速弱修复，房地产市场延续“销售回暖、投资仍待企稳”的分化格局，PPI 同比涨幅受基数效应以及油价回落影响将有所放缓，整体经济将呈现“稳中承压、结构分化”的运行态势。

海外方面，6 月 FOMC 会议是新任主席沃什首秀，政策利率不变，但会议释放了强烈鹰派信号。展望未来，随着美伊冲突和谈进展推进，油价已出现快速回落，三季度通胀或将迎来回落，届时紧缩预期或逐步缓解，若就业市场超预期走弱，市场或重新定价美联储的宽松预期。

债券方面，目前在内需偏弱以及实体扩张不足的背景下，预计债券收益率预期维持低位，组合维持中性久期。股票上我们的目标是追求组合稳健增长，将继续围绕选股展开，聚焦于生意和公司，坚持长周期的思考，寻找各领域有独特竞争优势，业务有差异化并形成竞争壁垒，且在估值层面具备安全边际的企业。我们的持仓将继续围绕具备持续增长潜力的公司或者具备较强可持续回报的公司，他们 Forward-PE 在一个很有吸引力的区间。我们将继续提升认知深度，增强公司

差异化商业模式的思考，综合评估风险收益比。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-0.52%，业绩比较基准收益率为 1.83%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为-0.62%，业绩比较基准收益率为 1.83%。

#### 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              | 54,321,238.83  | 15.35        |
|    | 其中：股票             | 54,321,238.83  | 15.35        |
| 2  | 基金投资              | —              | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 287,848,688.93 | 81.36        |
|    | 其中：债券             | 287,848,688.93 | 81.36        |
|    | 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          | 7,000,000.00   | 1.98         |
|    | 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      | 3,777,783.54   | 1.07         |
| 8  | 其他资产              | 857,672.00     | 0.24         |
| 9  | 合计                | 353,805,383.30 | 100.00       |

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 18,642,376.55 元，占基金资产净值的比例为 5.90%。

#### 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         | 2,386,200.00  | 0.76         |
| B  | 采矿业              | 1,375,432.00  | 0.44         |
| C  | 制造业              | 20,381,738.28 | 6.46         |
| 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     | 1,926,717.00  | 0.61  |
| H | 住宿和餐饮业          | —             | —     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,481,952.00  | 0.47  |
| J | 金融业             | 5,599,270.00  | 1.77  |
| 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      | 2,527,553.00  | 0.80  |
| 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              | 35,678,862.28 | 11.30 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别   | 公允价值（人民币）     | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 材料     | 762,152.63    | 0.24         |
| 必需消费品  | 611,094.41    | 0.19         |
| 非必需消费品 | —             | —            |
| 能源     | 300,031.91    | 0.10         |
| 金融     | —             | —            |
| 政府     | —             | —            |
| 工业     | 1,694,473.30  | 0.54         |
| 医疗保健   | —             | —            |
| 房地产    | 4,202,913.45  | 1.33         |
| 科技     | 3,354,253.25  | 1.06         |
| 公用事业   | —             | —            |
| 通讯     | 7,717,457.60  | 2.44         |
| 合计     | 18,642,376.55 | 5.90         |

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

### 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  | 00700  | 腾讯控股 | 19,000  | 7,092,753.01 | 2.25         |
| 2  | 600150 | 中国船舶 | 102,600 | 3,466,854.00 | 1.10         |
| 3  | 300677 | 英科医疗 | 82,600  | 3,235,442.00 | 1.02         |
| 4  | 00981  | 中芯国际 | 33,000  | 2,562,396.21 | 0.81         |

|    |        |        |         |              |      |
|----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 5  | 603259 | 药明康德   | 20,300  | 2,527,553.00 | 0.80 |
| 6  | 600919 | 江苏银行   | 228,600 | 2,464,308.00 | 0.78 |
| 7  | 601118 | 海南橡胶   | 485,000 | 2,386,200.00 | 0.76 |
| 8  | 601077 | 渝农商行   | 378,000 | 2,309,580.00 | 0.73 |
| 9  | 01908  | 建发国际集团 | 194,000 | 2,274,732.45 | 0.72 |
| 10 | 01109  | 华润置地   | 74,000  | 1,928,181.00 | 0.61 |

#### 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      | 40,788,838.51  | 12.92        |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | 226,552,614.25 | 71.76        |
|    | 其中：政策性金融债 | 121,351,112.33 | 38.44        |
| 4  | 企业债券      | —              | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —              | —            |
| 6  | 中期票据      | 20,507,236.17  | 6.50         |
| 7  | 可转债（可交换债） | —              | —            |
| 8  | 同业存单      | —              | —            |
| 9  | 其他        | —              | —            |
| 10 | 合计        | 287,848,688.93 | 91.17        |

#### 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  | 240403   | 24 农发 03     | 800,000 | 80,963,769.86 | 25.64        |
| 2  | 09240202 | 24 国开清发 02   | 400,000 | 40,387,342.47 | 12.79        |
| 3  | 2500004  | 25 超长特别国债 04 | 300,000 | 29,146,723.76 | 9.23         |
| 4  | 2128036  | 21 平安银行二级    | 200,000 | 20,627,267.95 | 6.53         |
| 5  | 230023   | 23 附息国债 23   | 100,000 | 11,642,114.75 | 3.69         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则，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。

### 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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

中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局处罚。

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

平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局处罚。

重庆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国家金融监督管理总局地方监管局处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内未出现被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金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   | 89,308.98  |
| 2  | 应收证券清算款 | 667,833.46 |
| 3  | 应收股利    | 100,089.75 |
| 4  | 应收利息    | —          |
| 5  | 应收申购款   | 439.81     |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 其他      | —          |

|   |    |            |
|---|----|------------|
| 8 | 合计 | 857,672.00 |
|---|----|------------|

#### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §6 基金中基金

#### 6.1 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

##### 6.1.1 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公开募集不动产投资信托基金投资明细

本基金本报告期末未持有公开募集不动产投资信托基金。

##### 6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

本基金本报告期末未持有公开募集不动产投资信托基金。

#### 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期费用 2026 年 4 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 其中：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 |
|----------------------|--------------------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费(元)      | —                                    | —                               |
| 当期交易基金产生的赎回费(元)      | 213.92                               | —                               |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费(元) | —                                    | —                               |
| 当期持有基金产生的应支付管理费(元)   | 1,427.18                             | —                               |
| 当期持有基金产生的应支付托管费(元)   | 285.44                               | —                               |

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

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

用项目；

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

### 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

## § 7 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   |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 406,207,348.47 | 365,426,451.90 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 59,284,851.26  | 28,112,164.11  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 257,760,846.91 | 306,901,180.42 |
| 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               | 207,731,352.82 | 86,637,435.59  |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## §8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 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。

### 8.2 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。

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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              | 20260528-20260528        | 84,137,651.71 | 34,083,194.29 | 72,127,012.10 | 46,093,833.90 | 15.66    |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 2              | 20260601-20260602        | 99,219,907.17 | -             | 73,896,175.87 | 25,323,731.30 | 8.60     |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                          |               |               |               |               |          |
| <p>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：</p> <p>1、大额申购风险</p> <p>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。</p> <p>2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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。</p> <p>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。</p> |                |                          |               |               |               |               |          |

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §10 备查文件目录

### 10.1 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。

## 10.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

## 10.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2026 年 7 月 21 日