

# 景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <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>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 其他指标                                | 10        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 15        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |
| 6.2 利润表                                 | 16        |
| 6.3 净资产变动表                              | 18        |
| 6.4 报表附注                                | 20        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>42</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 42        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 42        |
| 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       | 43        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 44        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 45        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 .....    | 45        |
| 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 ..... | 46        |
| 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 ..... | 46        |
| 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 .....    | 46        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 46        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 46        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>48</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 48        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 49        |
| 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 .....      | 49        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>49</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>50</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 50        |
| 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 .....      | 50        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 50        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 50        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 50        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....          | 50        |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....      | 51        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 53        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>56</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 .....    | 56        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 56        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>56</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 56        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 56        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 56        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                     |                    |                     |
|-----------------|---------------------|--------------------|---------------------|
| 基金名称            | 景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金   |                    |                     |
| 基金简称            | 景顺长城景颐丰利债券          |                    |                     |
| 场内简称            | 无                   |                    |                     |
| 基金主代码           | 003504              |                    |                     |
| 基金运作方式          | 契约型开放式              |                    |                     |
| 基金合同生效日         | 2017 年 1 月 18 日     |                    |                     |
| 基金管理人           | 景顺长城基金管理有限公司        |                    |                     |
| 基金托管人           | 北京银行股份有限公司          |                    |                     |
| 报告期末基金份额总额      | 41,559,443,041.66 份 |                    |                     |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                    |                     |
| 下属分级基金的基金简称     | 景顺长城景颐丰利债券 A 类      | 景顺长城景颐丰利债券 C 类     | 景顺长城景颐丰利债券 F 类      |
| 下属分级基金的交易代码     | 003504              | 003505             | 023512              |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 13,736,556,760.51 份 | 3,787,838,401.27 份 | 24,035,047,879.88 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品种，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>本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会，根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略</p> <p>（1）债券类属资产配置</p> <p>基金管理人根据国债、金融债、企业（公司）债、分离交易可转债债券部分等品种与同期限国债或央票之间收益率利差的扩大和收窄的分析，主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。</p> <p>（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）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>3、权益资产投资策略</p> <p>（1）股票投资策略</p> <p>本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略，本基金将从定性及定量两个方面加以考察分析投资标的。</p> <p>（2）权证投资策略</p> <p>本基金不直接购买权证等衍生品资产，但有可能持有所持股票所派发的权证或因投资分离交易可转债而产生的权证等。本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，结合权证的溢价率、隐含波动率等指标选择权证的卖出时机。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证综合债指数×90% + 沪深 300 指数×10%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 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                 | 北京银行股份有限公司                   |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 杨皞阳                          | 闫朝                           |
|         | 联系电话 | 0755-82370388                | 010-66223587                 |
|         | 电子邮箱 | investor@igwfm.com           | yanzhao@bankofbeijing.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 4008888606                   | 95526                        |
| 传真      |      | 0755-22381339                | 010-89661115                 |
| 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甲 17 号首层           |
| 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 | 北京市西城区金融大街丙 17 号             |
| 邮政编码    |      | 518048                       | 100033                       |
| 法定代表人   |      | 叶才                           | 关文杰                          |

## 2.4 信息披露方式

|                   |               |
|-------------------|---------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 证券时报          |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.igwfm.com |
| 基金中期报告置备地点        | 基金管理人的办公场所    |

## 2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间     | 报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |                  |                   |
|--------------|-------------------------------------|------------------|-------------------|
| 数据和指标        | 景顺长城景颐丰利债券 A 类                      | 景顺长城景颐丰利债券 C 类   | 景顺长城景颐丰利债券 F 类    |
| 本期已实现收益      | 543,297,283.52                      | 118,383,841.71   | 871,946,985.45    |
| 本期利润         | 2,091,457,117.34                    | 460,613,088.73   | 3,187,804,849.52  |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2084                              | 0.1965           | 0.1999            |
| 本期加权平均净值利润率  | 13.14%                              | 12.68%           | 12.60%            |
| 本期基金份额净值增长率  | 14.05%                              | 13.82%           | 14.04%            |
| 3.1.2 期末     | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)               |                  |                   |
| 数据和指标        |                                     |                  |                   |
| 期末可供分配利润     | 4,453,813,069.16                    | 1,098,969,545.04 | 7,783,410,403.78  |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3242                              | 0.2901           | 0.3238            |
| 期末基金资产净值     | 23,594,622,556.61                   | 6,341,848,096.73 | 41,272,265,434.09 |
| 期末基金份额净值     | 1.7176                              | 1.6742           | 1.7171            |
| 3.1.3 累计     | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)               |                  |                   |
| 期末指标         |                                     |                  |                   |
| 基金份额累计净值增长率  | 80.56%                              | 76.00%           | 38.45%            |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣

- 除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
- 3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。
- 4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城景颐丰利债券 A 类

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 13.73%   | 0.64%       | 2.26%      | 0.14%         | 11.47% | 0.50% |
| 过去六个月      | 14.05%   | 0.57%       | 2.63%      | 0.12%         | 11.42% | 0.45% |
| 过去一年       | 34.29%   | 0.54%       | 4.01%      | 0.11%         | 30.28% | 0.43% |
| 过去三年       | 53.22%   | 0.55%       | 15.13%     | 0.11%         | 38.09% | 0.44% |
| 过去五年       | 56.17%   | 0.57%       | 21.28%     | 0.12%         | 34.89% | 0.45% |
| 过去七年       | 65.17%   | 0.53%       | 34.57%     | 0.12%         | 30.60% | 0.41% |
| 自基金合同生效起至今 | 80.56%   | 0.46%       | 49.88%     | 0.12%         | 30.68% | 0.34% |

景顺长城景颐丰利债券 C 类

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 13.61%   | 0.63%       | 2.26%      | 0.14%         | 11.35% | 0.49% |
| 过去六个月 | 13.82%   | 0.57%       | 2.63%      | 0.12%         | 11.19% | 0.45% |
| 过去一年  | 33.75%   | 0.54%       | 4.01%      | 0.11%         | 29.74% | 0.43% |
| 过去三年  | 51.42%   | 0.55%       | 15.13%     | 0.11%         | 36.29% | 0.44% |
| 过去五年  | 53.86%   | 0.57%       | 21.28%     | 0.12%         | 32.58% | 0.45% |
| 过去七年  | 61.42%   | 0.53%       | 34.57%     | 0.12%         | 26.85% | 0.41% |



|                |        |       |        |       |        |       |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起<br>至今 | 76.00% | 0.46% | 49.88% | 0.12% | 26.12% | 0.34% |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|

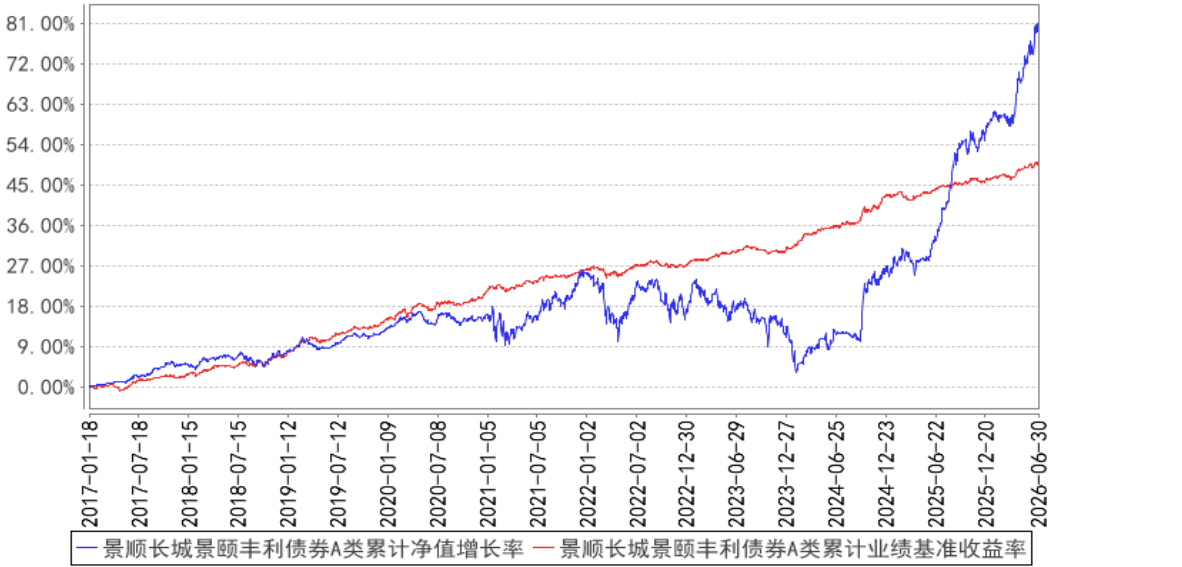
景顺长城景颐丰利债券 F 类

| 阶段             | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 13.72%   | 0.63%       | 2.26%      | 0.14%         | 11.46% | 0.49% |
| 过去六个月          | 14.04%   | 0.57%       | 2.63%      | 0.12%         | 11.41% | 0.45% |
| 过去一年           | 34.27%   | 0.54%       | 4.01%      | 0.11%         | 30.26% | 0.43% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 38.45%   | 0.52%       | 5.18%      | 0.11%         | 33.27% | 0.41% |

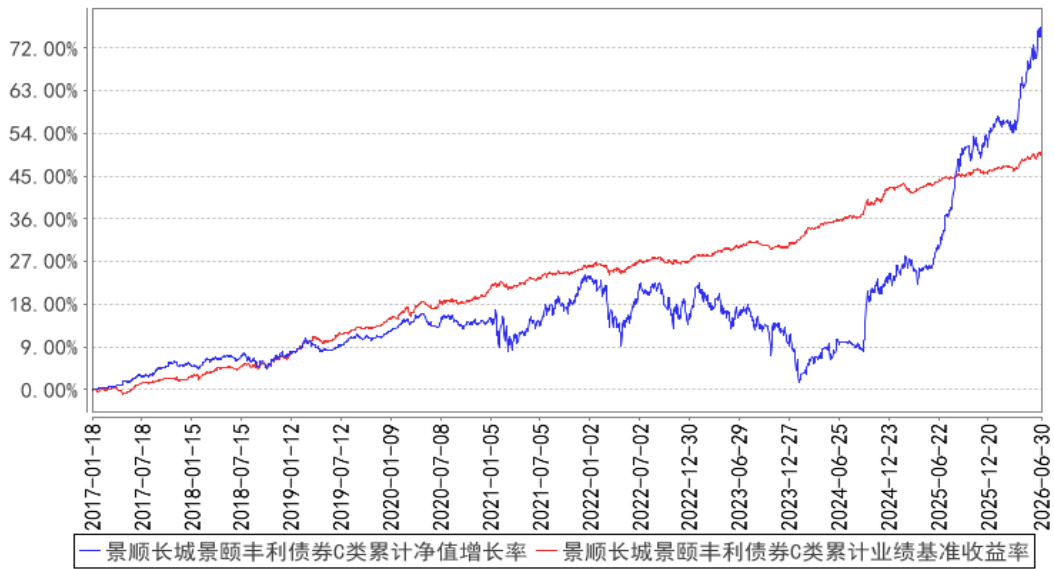
注：本基金于 2025 年 02 月 21 日增设 F 类基金份额，并于 2025 年 02 月 25 日开始对 F 类份额进行估值。

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

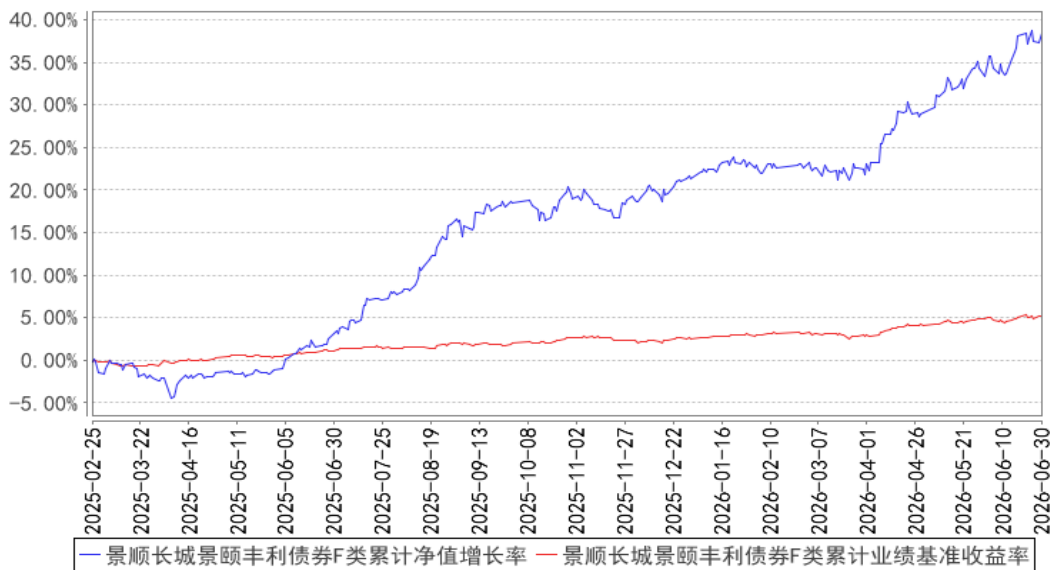
景顺长城景颐丰利债券A类累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



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



注：基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2017 年 1 月 18 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。本基金自 2025 年 2 月 21 日起增设 F 类基金份额。

### 3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003] 76 号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2026 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 233 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名    | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                 |
|-------|----------|-----------------|------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|       |          | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                    |
| 徐栋    | 本基金的基金经理 | 2022 年 5 月 25 日 | -    | 17 年   | 经济学硕士。曾任国投瑞银基金管理有限公司固定收益部研究员、基金经理助理、基金经理、总监助理兼基金经理。2020 年 12 月加入本公司，担任混合资产投资部基金经理助理，自 2022 年 5 月起担任混合资产投资部基金经理。具有 17 年证券、基金行业从业经验。                                                 |
| 李 怡 文 | 本基金的基金经理 | 2024 年 6 月 18 日 | -    | 20 年   | 工商管理硕士。曾任国家外汇管理局会计处组合分析师，弗罗里瑞伟投资管理公司研究员，中国建设银行香港组合管理经理，国投瑞银基金管理有限公司固定收益部副总监、基金经理。2020 年 4 月加入本公司，担任固定收益部稳定收益业务投资负责人，自 2021 年 4 月起担任固定收益部基金经理，现任混合资产投资部总经理、基金经理。具有 20 年证券、基金行业从业经验。 |
| 江山    | 本基金的基金经理 | 2024 年 7 月 10 日 | -    | 13 年   | 理学硕士。曾任宝盈基金管理有限公司产品规划部产品经理、研究部研究员，国投瑞银基金管理有限公司资产配置部研究员、专户投资部投资经理、研究部研究员，                                                                                                           |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                  |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 长安基金管理有限公司权益投资部基金经理、研究部副总监兼基金经理。2023 年 12 月加入本公司，自 2024 年 7 月起担任混合资产投资部基金经理，现任混合资产投资部总监、基金经理。具有 13 年证券、基金行业从业经验。 |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为公司决定且公告的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”及“离任日期”指根据公司决定且公告的聘任、解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 10 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年国内外重要宏观变量出现变化，带动资本市场出现大幅波动。首先，美伊冲突一季度快速升级到二季度逐步降温，期间带动原油期货价格大幅波动，冲击全球能源供应链安全。原油价格的大幅波动不仅冲击全球金融市场风险偏好，也显著影响全球央行的货币政策操作。其次，今年上半年 AI 产业快速发展，国内外大模型迭代加速、Token 需求量爆发，算力需求的快速增长带动 AI 全产业链需求量大增，进一步推动全行业资本开支大幅增长。国内经济方面，上半年经济总量增长保持平稳，结构有明显分化，其中出口持续保持高增速，但国内投资和消费需求偏弱；货币政策方面，央行保持稳健的货币政策，银行间资金价格总体平稳，Dr007 围绕 1.4% 波动。

股票市场方面，受益于 AI 行业快速发展，全球资本市场上半年小幅上涨，但其中科技股表现出色；A 股科创综指、创业板指数上半年分别上涨 53.99%、35.58%；其中电子、通信等 AI 产业链涨幅领先，热门行业成交量占全市场交易量大幅攀升，对其它行业产生虹吸效应；基本面相对平淡的其它行业在经历四月份反弹后持续下跌，半年末部分行业指数回落到年内低点。债券方面，受益于宽松的资金价格及疲弱的融资需求，债券收益率曲线各关键期限收益率普遍下行 20-30BP，30Y 国债受供给影响表现相对较弱，收益率曲线呈陡峭化。转债市场上半年表现类似于股票市场，宽幅震荡且结构上呈现显著分化，AI 相关行业转债表现突出，传统行业转债则普遍下跌。

组合操作方面，上半年经过对 AI 行业进一步的思考和审视，我们将持仓向 AI 算力进一步集中，同时减持了机器人和新能源，重点增加了半导体行业的持仓比例。纯债方面，我们组合年初以来保持长久期，较好地把握住上半年债券的交易机会。转债方面，受高溢价影响，我们整体保持偏低仓位，期间会在市场下跌中逐步增加持仓，新增持仓集中在中大盘转债。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 14.05%，业绩比较基准收益率为 2.63%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 13.82%，业绩比较基准收益率为 2.63%。

本报告期内，本基金 F 类份额净值增长率为 14.04%，业绩比较基准收益率为 2.63%。

#### 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，我们认为当前对于美联储较高的加息预期可能随着原油价格回落及世界杯效应褪去后会有所修正，加息预期的消退有利于全球资本市场，同时由于高油价带来的供给冲击可能会在三季度有所回摆，修复全球需求，有助于我们出口继续保持韧性。国内方面，我们期待三季度在内需方面可能会有更多的支持性政策出台或加速落地。

二季度以来，市场以非常激烈的方式表达着实体经济的状况，AI 带动的资本支出成为海外主

要的经济增长动力，美联储的最新表态也将 AI 的影响描述为“已知的未知”，与其争论泡沫，我们选择把时间花在研究产业供需变化上，即使未来裂痕出现的时候，也是产业里春江水暖鸭先知。

行业层面，半导体行业在组合中的重要性正在快速提升，随着全球 AI 资本开支体量朝着万亿美金级别迈进，芯片制造行业面临着全面的产能不足和挤出效应，这一状态将为上游设备材料、中游晶圆制造、下游 IC 设计带来系统性的投资机会，半导体行业或将进入远超前两轮的超级周期。此外，随着海外巨头开始交付新版本硬件系统，其供应链也将于三季度步入交付旺季，传统算力供应链业绩扎实、估值合理，也是我们继续重点看好的方向。

债券市场方面，虽然短期内我们期待新的内需政策加码，但政策力度我们难以过高期待。我们认为债券市场可能依旧处于窄幅震荡的区间，收益率曲线下行受制于资金价格，收益率曲线上行受限于融资需求。转债市场，我们相对偏谨慎，过高的转股溢价率透支未来的收益空间，我们更多专注于中低价格大盘转债的投资机会，整体仓位保持低位。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。基金估值委员会的成员包括投资部、研究部/固定收益部信评人员、基金事务部、法律监察稽核部、风险管理部等相关人员。本基金托管人根据基金合同及法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在托管景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议约定，对本基金的投资运作进行了监督，为本基金独立建账、独立核算、独立估值，按照托管协议约定的频率与管理人进行账务核对，本报告中利润分配情况真实、准确。

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

本报告期内，本基金托管人在能够知悉和掌握的信息范围内，按照国家法律法规规定、基金合同和托管协议约定，复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“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”、“关联方报酬-应支付销售机构的客户维护费”、“关联方报酬-销售服务费”、“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告相关内容，复核内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                        |                          |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 1,964,055,437.97       | 141,004,805.74           |
| 结算备付金    |         | 45,478,725.86          | 59,311,263.51            |
| 存出保证金    |         | 11,530,584.33          | 6,438,846.31             |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 75,229,512,147.45      | 39,816,626,494.16        |
| 其中：股票投资  |         | 14,526,385,797.73      | 6,151,027,851.98         |
| 基金投资     |         | -                      | -                        |
| 债券投资     |         | 60,703,126,349.72      | 33,665,598,642.18        |
| 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 | -                      | 700,031,716.93           |
| 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    |         | -                      | 469,023,578.31           |

|           |          |                        |                          |
|-----------|----------|------------------------|--------------------------|
| 应收股利      |          | -                      | -                        |
| 应收申购款     |          | 1,066,853,749.83       | 434,734,536.49           |
| 递延所得税资产   |          | -                      | -                        |
| 其他资产      | 6.4.7.8  | 25.00                  | -                        |
| 资产总计      |          | 78,317,430,670.44      | 41,627,171,241.45        |
| 负债和净资产    | 附注号      | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
| 负 债:      |          |                        |                          |
| 短期借款      |          | -                      | -                        |
| 交易性金融负债   |          | -                      | -                        |
| 衍生金融负债    | 6.4.7.3  | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款 |          | 5,938,739,164.13       | 7,675,884,005.39         |
| 应付清算款     |          | 445,434,737.45         | 245,634,758.68           |
| 应付赎回款     |          | 685,532,060.97         | 178,827,737.17           |
| 应付管理人报酬   |          | 20,545,139.34          | 9,502,111.10             |
| 应付托管费     |          | 7,704,427.26           | 3,563,291.65             |
| 应付销售服务费   |          | 2,046,223.30           | 798,916.04               |
| 应付投资顾问费   |          | -                      | -                        |
| 应交税费      |          | 750,586.57             | 141,119.33               |
| 应付利润      |          | -                      | -                        |
| 递延所得税负债   |          | -                      | -                        |
| 其他负债      | 6.4.7.9  | 7,942,243.99           | 5,625,052.29             |
| 负债合计      |          | 7,108,694,583.01       | 8,119,976,991.65         |
| 净资产:      |          |                        |                          |
| 实收基金      | 6.4.7.10 | 41,559,443,041.66      | 22,295,183,784.70        |
| 其他综合收益    | 6.4.7.11 | -                      | -                        |
| 未分配利润     | 6.4.7.12 | 29,649,293,045.77      | 11,212,010,465.10        |
| 净资产合计     |          | 71,208,736,087.43      | 33,507,194,249.80        |
| 负债和净资产总计  |          | 78,317,430,670.44      | 41,627,171,241.45        |

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 41,559,443,041.66 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.7176 元，基金份额 13,736,556,760.51 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.6742 元，基金份额 3,787,838,401.27 份；本基金 F 类份额净值人民币 1.7171 元，基金份额 24,035,047,879.88 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|-----|-----|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
|-----|-----|------------------------------------------|-----------------------------------------------|



|                        |            |                  |                |
|------------------------|------------|------------------|----------------|
| 一、营业总收入                |            | 5,908,844,228.03 | 93,786,443.25  |
| 1. 利息收入                |            | 5,532,782.05     | 462,803.56     |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.13   | 2,581,312.50     | 135,064.75     |
| 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             |            | 2,951,469.55     | 327,738.81     |
| 其他利息收入                 |            | -                | -              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 1,692,984,880.82 | -20,560,545.98 |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.14   | 1,124,330,080.00 | -53,756,648.14 |
| 基金投资收益                 |            | -                | -              |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.15   | 550,024,741.34   | 32,455,111.48  |
| 资产支持证券投资               | 6.4.7.16   | -                | -              |
| 收益                     |            |                  |                |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.17   | -                | -              |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.18   | -                | -              |
| 股利收益                   | 6.4.7.19   | 18,630,059.48    | 740,990.68     |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益  |            | -                | -              |
| 其他投资收益                 |            | -                | -              |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20   | 4,206,246,944.91 | 113,613,024.27 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                | -              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.21   | 4,079,620.25     | 271,161.40     |
| 减：二、营业总支出              |            | 168,969,172.44   | 6,707,797.20   |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 88,718,109.83    | 2,703,006.57   |
| 其中：暂估管理人报酬             |            | -                | -              |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 33,269,291.24    | 1,013,627.54   |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | 8,400,990.29     | 305,983.54     |
| 4. 投资顾问费               |            | -                | -              |
| 5. 利息支出                |            | 38,163,534.53    | 2,600,808.72   |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 38,163,534.53    | 2,600,808.72   |
| 6. 信用减值损失              | 6.4.7.22   | -                | -              |
| 7. 税金及附加               |            | 260,061.61       | 2,920.14       |
| 8. 其他费用                | 6.4.7.23   | 157,184.94       | 81,450.69      |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | 5,739,875,055.59 | 87,078,646.05  |
| 减：所得税费用                |            | -                | -              |

|                   |  |                  |               |
|-------------------|--|------------------|---------------|
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) |  | 5,739,875,055.59 | 87,078,646.05 |
| 五、其他综合收益的税后净额     |  | -                | -             |
| 六、综合收益总额          |  | 5,739,875,055.59 | 87,078,646.05 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |        |                    |                    |
|-------------------------------------|---------------------------------------|--------|--------------------|--------------------|
|                                     | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润              | 净资产合计              |
| 一、上期期末净资产                           | 22,295,183,784.70                     | -      | 11,212,010,465.10  | 33,507,194,249.80  |
| 加：会计政策变更                            | -                                     | -      | -                  | -                  |
| 前期差错更正                              | -                                     | -      | -                  | -                  |
| 其他                                  | -                                     | -      | -                  | -                  |
| 二、本期期初净资产                           | 22,295,183,784.70                     | -      | 11,212,010,465.10  | 33,507,194,249.80  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | 19,264,259,256.96                     | -      | 18,437,282,580.67  | 37,701,541,837.63  |
| (一)、综合收益总额                          | -                                     | -      | 5,739,875,055.59   | 5,739,875,055.59   |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列) | 19,264,259,256.96                     | -      | 12,697,407,525.08  | 31,961,666,782.04  |
| 其中：1. 基金申购款                         | 46,340,511,275.64                     | -      | 27,801,453,140.46  | 74,141,964,416.10  |
| 2. 基金赎回款                            | -27,076,252,018.68                    | -      | -15,104,045,615.38 | -42,180,297,634.06 |
| (三)、本期向基金份额持有人分                     | -                                     | -      | -                  | -                  |

|                                          |                                             |        |                   |                   |
|------------------------------------------|---------------------------------------------|--------|-------------------|-------------------|
| 配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）                |                                             |        |                   |                   |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -                                           | -      | -                 | -                 |
| 四、本期期末净资产                                | 41,559,443,041.66                           | -      | 29,649,293,045.77 | 71,208,736,087.43 |
| 项目                                       | 上上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |        |                   |                   |
|                                          | 实收基金                                        | 其他综合收益 | 未分配利润             | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                                | 169,751,433.03                              | -      | 33,119,306.73     | 202,870,739.76    |
| 加：会计政策变更                                 | -                                           | -      | -                 | -                 |
| 前期差错更正                                   | -                                           | -      | -                 | -                 |
| 其他                                       | -                                           | -      | -                 | -                 |
| 二、本期期初净资产                                | 169,751,433.03                              | -      | 33,119,306.73     | 202,870,739.76    |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 2,626,521,199.55                            | -      | 741,053,296.86    | 3,367,574,496.41  |
| （一）、综合收益总额                               | -                                           | -      | 87,078,646.05     | 87,078,646.05     |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | 2,626,521,199.55                            | -      | 653,974,650.81    | 3,280,495,850.36  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 3,369,330,487.48                            | -      | 807,774,064.81    | 4,177,104,552.29  |
| 2. 基金赎回款                                 | -742,809,287.93                             | -      | -153,799,414.00   | -896,608,701.93   |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                                           | -      | -                 | -                 |

|                  |                  |   |                |                  |
|------------------|------------------|---|----------------|------------------|
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | -                | - | -              | -                |
| 四、本期期末净资产        | 2,796,272,632.58 | - | 774,172,603.59 | 3,570,445,236.17 |

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

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）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[2016]1216 号《关于准予景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金注册的批复》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《景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 274,587,431.41 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2017）第 26 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 274,687,639.40 份基金份额，其中认购资金利息折合 100,207.99 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，基金托管人为北京银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券（含分离型可转换债券）、银行存款等。本基金同时投资于 A 股股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资

产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款。

本基金初始基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额，自 2025 年 2 月 21 日起增设 F 类基金份额。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2026 年 8 月 26 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 6.4.6 税项

### （1）增值税及附加

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

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

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

### （2）企业所得税

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

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

### （3）个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款   | 1,964,055,437.97       |
| 等于：本金  | 1,964,010,270.46       |
| 加：应计利息 | 45,167.51              |
| 减：坏账准备 | —                      |
| 定期存款   | —                      |
| 等于：本金  | —                      |
| 加：应计利息 | —                      |

|                   |                  |
|-------------------|------------------|
| 减：坏账准备            | -                |
| 其中：存款期限 1 个月以内    | -                |
| 存款期限 1 个月（含）-3 个月 | -                |
| 存款期限 3 个月（含）至 1 年 | -                |
| 存款期限 1 年（含）以上     | -                |
| 其他存款              | -                |
| 等于：本金             | -                |
| 加：应计利息            | -                |
| 减：坏账准备            | -                |
| 合计                | 1,964,055,437.97 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                    |               | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |                   |                       |                      |
|-----------------------|---------------|------------------------|-------------------|-----------------------|----------------------|
|                       |               | 成本                     | 应计利息              | 公允价值                  | 公允价值变动               |
| 股票                    |               | 8, 924, 742, 634. 66   | -                 | 14, 526, 385, 797. 73 | 5, 601, 643, 163. 07 |
| 贵金属投资-<br>金交所黄金<br>合约 |               | -                      | -                 | -                     | -                    |
| 债券                    | 交易<br>所市<br>场 | 8, 290, 006, 380. 66   | 65, 528, 009. 39  | 7, 991, 566, 215. 05  | -363, 968, 175. 00   |
|                       | 银行<br>间市<br>场 | 52, 045, 644, 270. 29  | 372, 215, 634. 67 | 52, 711, 560, 134. 67 | 293, 700, 229. 71    |
|                       | 合计            | 60, 335, 650, 650. 95  | 437, 743, 644. 06 | 60, 703, 126, 349. 72 | -70, 267, 945. 29    |
| 资产支持证<br>券            |               | -                      | -                 | -                     | -                    |
| 基金                    |               | -                      | -                 | -                     | -                    |
| 其他                    |               | -                      | -                 | -                     | -                    |
| 合计                    |               | 69, 260, 393, 285. 61  | 437, 743, 644. 06 | 75, 229, 512, 147. 45 | 5, 531, 375, 217. 78 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。



6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 应收利息  | -                      |
| 其他应收款 | 25.00                  |
| 待摊费用  | -                      |
| 合计    | 25.00                  |

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

|             | 2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -               |
| 应付赎回费       | 512,631.82      |
| 应付证券出借违约金   | -               |
| 应付交易费用      | 7,323,612.92    |
| 其中：交易所市场    | 7,050,372.51    |
| 银行间市场       | 273,240.41      |
| 应付利息        | -               |
| 预提费用        | 105,999.25      |
| 合计          | 7,942,243.99    |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 景顺长城景颐丰利债券 A 类

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                   |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额              |
| 上年度末          | 6,689,575,515.41                      | 6,689,575,515.41  |
| 本期申购          | 14,026,097,098.87                     | 14,026,097,098.87 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -6,979,115,853.77                     | -6,979,115,853.77 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -                 |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -                 |
| 本期申购          | -                                     | -                 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -                 |
| 本期末           | 13,736,556,760.51                     | 13,736,556,760.51 |

##### 景顺长城景颐丰利债券 C 类

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                   |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额              |
| 上年度末          | 1,877,705,391.93                      | 1,877,705,391.93  |
| 本期申购          | 4,353,381,986.30                      | 4,353,381,986.30  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,443,248,976.96                     | -2,443,248,976.96 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -                 |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -                 |
| 本期申购          | -                                     | -                 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -                 |
| 本期末           | 3,787,838,401.27                      | 3,787,838,401.27  |

##### 景顺长城景颐丰利债券 F 类

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                    |
|---------------|---------------------------------------|--------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额               |
| 上年度末          | 13,727,902,877.36                     | 13,727,902,877.36  |
| 本期申购          | 27,961,032,190.47                     | 27,961,032,190.47  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -17,653,887,187.95                    | -17,653,887,187.95 |

|               |                   |                   |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 基金拆分/份额折算前    | -                 | -                 |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                 | -                 |
| 本期申购          | -                 | -                 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                 | -                 |
| 本期末           | 24,035,047,879.88 | 24,035,047,879.88 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 景顺长城景颐丰利债券 A 类

| 项目             | 已实现部分             | 未实现部分             | 未分配利润合计           |
|----------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 上年度末           | 1,809,610,579.05  | 1,575,889,195.41  | 3,385,499,774.46  |
| 加：会计政策变更       | -                 | -                 | -                 |
| 前期差错更正         | -                 | -                 | -                 |
| 其他             | -                 | -                 | -                 |
| 本期期初           | 1,809,610,579.05  | 1,575,889,195.41  | 3,385,499,774.46  |
| 本期利润           | 543,297,283.52    | 1,548,159,833.82  | 2,091,457,117.34  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,100,905,206.59  | 2,280,203,697.71  | 4,381,108,904.30  |
| 其中：基金申购款       | 4,148,061,775.18  | 4,245,491,247.84  | 8,393,553,023.02  |
| 基金赎回款          | -2,047,156,568.59 | -1,965,287,550.13 | -4,012,444,118.72 |
| 本期已分配利润        | -                 | -                 | -                 |
| 本期末            | 4,453,813,069.16  | 5,404,252,726.94  | 9,858,065,796.10  |

##### 景顺长城景颐丰利债券 C 类

| 项目             | 已实现部分            | 未实现部分            | 未分配利润合计           |
|----------------|------------------|------------------|-------------------|
| 上年度末           | 452,072,920.62   | 432,184,940.39   | 884,257,861.01    |
| 加：会计政策变更       | -                | -                | -                 |
| 前期差错更正         | -                | -                | -                 |
| 其他             | -                | -                | -                 |
| 本期期初           | 452,072,920.62   | 432,184,940.39   | 884,257,861.01    |
| 本期利润           | 118,383,841.71   | 342,229,247.02   | 460,613,088.73    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 528,512,782.71   | 680,625,963.01   | 1,209,138,745.72  |
| 其中：基金申购款       | 1,159,838,794.43 | 1,322,084,515.10 | 2,481,923,309.53  |
| 基金赎回款          | -631,326,011.72  | -641,458,552.09  | -1,272,784,563.81 |
| 本期已分配利润        | -                | -                | -                 |
| 本期末            | 1,098,969,545.04 | 1,455,040,150.42 | 2,554,009,695.46  |

##### 景顺长城景颐丰利债券 F 类

| 项目   | 已实现部分            | 未实现部分            | 未分配利润合计          |
|------|------------------|------------------|------------------|
| 上年度末 | 3,709,065,076.62 | 3,233,187,753.01 | 6,942,252,829.63 |

|                |                   |                   |                   |
|----------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 加：会计政策变更       | -                 | -                 | -                 |
| 前期差错更正         | -                 | -                 | -                 |
| 其他             | -                 | -                 | -                 |
| 本期期初           | 3,709,065,076.62  | 3,233,187,753.01  | 6,942,252,829.63  |
| 本期利润           | 871,946,985.45    | 2,315,857,864.07  | 3,187,804,849.52  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,202,398,341.71  | 3,904,761,533.35  | 7,107,159,875.06  |
| 其中：基金申购款       | 8,305,477,862.09  | 8,620,498,945.82  | 16,925,976,807.91 |
| 基金赎回款          | -5,103,079,520.38 | -4,715,737,412.47 | -9,818,816,932.85 |
| 本期已分配利润        | -                 | -                 | -                 |
| 本期末            | 7,783,410,403.78  | 9,453,807,150.43  | 17,237,217,554.21 |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 1,555,949.15                          |
| 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 | 120,720.13                            |
| 其他        | 904,643.22                            |
| 合计        | 2,581,312.50                          |

#### 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>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 1,124,330,080.00           |
| 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               | 1,124,330,080.00           |

##### 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>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 15,273,519,696.84                     |
| 减：卖出股票成本总额 | 14,124,163,648.99                     |
| 减：交易费用     | 25,025,967.85                         |
| 买卖股票差价收入   | 1,124,330,080.00                      |

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 388,540,262.73             |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 161,484,478.61             |
| 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                           | 550,024,741.34             |

## 6.4.7.15.2 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>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 32,006,514,700.27          |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 31,542,486,441.77          |
| 减：应计利息总额               | 301,680,670.79             |
| 减：交易费用                 | 863,109.10                 |
| 买卖债券差价收入               | 161,484,478.61             |

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 18,630,059.48                         |
| 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            | 18,630,059.48                         |

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 4,206,246,944.91                      |
| 股票投资                   | 4,275,342,485.70                      |
| 债券投资                   | -69,095,540.79                        |
| 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                     | 4,206,246,944.91                      |

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 3,685,076.42                          |
| 基金转换费收入 | 394,543.83                            |
| 合计      | 4,079,620.25                          |

## 6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 审计费用      | 37,191.88                             |
| 信息披露费     | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金   | -                                     |
| 债券托管账户维护费 | 18,600.00                             |
| 银行划款手续费   | 41,885.69                             |
| 合计        | 157,184.94                            |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称              | 与本基金的关系           |
|--------------------|-------------------|
| 景顺长城基金管理有限公司       | 基金管理人、登记机构、基金销售机构 |
| 北京银行股份有限公司（“北京银行”） | 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          |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                 |
|-------|---------------------------------------|-----------------|--------------------------------------------|-----------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期股票成交总额的比例（%） | 成交金额                                       | 占当期股票成交总额的比例（%） |
| 长城证券  | 1,075,529,043.29                      | 3.21            | 500,901,101.44                             | 21.55           |

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026年1月1日至2026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<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 长城证券  | 489,365.72                      | 3.21              | 489,365.72   | 6.94                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2025年1月1日至2025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<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 长城证券  | 227,910.21                      | 21.55             | 121,538.93   | 17.50               |

注：1、上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，被动股票型基金不得通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 | 上年度可比期间<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 88,718,109.83              | 2,703,006.57                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 10,089,385.68              | 238,811.74                      |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 78,628,724.15              | 2,464,194.83                    |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 | 上年度可比期间<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 33,269,291.24              | 1,013,627.54                    |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：



日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                              |                |                |              |
|----------------|---------------------------------|----------------|----------------|--------------|
|                | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                |                |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |                |                |              |
|                | 景顺长城景颐丰利债券 A 类                  | 景顺长城景颐丰利债券 C 类 | 景顺长城景颐丰利债券 F 类 | 合计           |
| 景顺长城基金管理有限公司   | -                               | 2,903,737.38   | 749,627.23     | 3,653,364.61 |
| 北京银行           | -                               | 8,931.31       | -              | 8,931.31     |
| 长城证券           | -                               | -              | -              | -            |
| 合计             | -                               | 2,912,668.69   | 749,627.23     | 3,662,295.92 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                         |                |                |              |
|                | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                |                |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |                |                |              |
|                | 景顺长城景颐丰利债券 A 类                  | 景顺长城景颐丰利债券 C 类 | 景顺长城景颐丰利债券 F 类 | 合计           |
| 景顺长城基金管理有限公司   | -                               | 147,366.00     | 6,907.16       | 154,273.16   |
| 北京银行           | -                               | 533.39         | -              | 533.39       |
| 长城证券           | -                               | -              | -              | -            |
| 合计             | -                               | 147,899.39     | 6,907.16       | 154,806.55   |

注：（1）支付基金销售机构的基金份额销售服务费按前一日对应类别基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。C 类基金份额和 F 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.40%和 0.01%。其计算公式为：

日销售服务费=前一日对应类别基金资产净值×对应类别约定年费率/当年天数。

（2）自 2025 年 2 月 21 日起，本基金在现有基金份额的基础上增设 F 类基金份额，原 A 类、C 类基金份额费率及相关业务规则不变。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 本期                              |               |       |      |                  |            |
|----------------|---------------------------------|---------------|-------|------|------------------|------------|
|                | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |               |       |      |                  |            |
|                | 债券交易金额                          |               | 基金逆回购 |      | 基金正回购            |            |
|                | 基金买入                            | 基金卖出          | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额             | 利息支出       |
| 北京银行           | 117,131,611.41                  | 27,579,884.18 | -     | -    | 1,420,000,000.00 | 689,254.11 |
| 上年度可比期间        |                                 |               |       |      |                  |            |

| 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |        |      |       |      |       |      |
|---------------------------------|--------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称              | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                 | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 北京银行                            | -      | -    | -     | -    | -     | -    |

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称   | 本期                              |              | 上年度可比期间                         |           |
|---------|---------------------------------|--------------|---------------------------------|-----------|
|         | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |              | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |           |
|         | 期末余额                            | 当期利息收入       | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 北京银行-活期 | 1,964,055,437.97                | 1,555,949.15 | 92,861,774.62                   | 84,363.54 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 3,250,598,337.45 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           |
|-----------|-----------------|----------------|--------|------------|------------------|
| 09240202  | 24 国开清发 02      | 2026 年 7 月 2 日 | 100.97 | 13,600,000 | 1,373,169,643.83 |
| 260205    | 26 国开 05        | 2026 年 7 月 3 日 | 101.86 | 11,500,000 | 1,171,337,698.63 |
| 232580008 | 25 工行二级资本债 02BC | 2026 年 7 月 6 日 | 101.22 | 5,300,000  | 536,461,033.97   |
| 250220    | 25 国开 20        | 2026 年 7 月 6 日 | 102.22 | 6,000,000  | 613,331,178.08   |
| 合计        |                 |                |        | 36,400,000 | 3,694,299,554.51 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 2,688,140,826.68 元，于 2026 年 07 月 06 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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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 45.32%（上年度末：61.92%）。

#### 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发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026年6月30日   | 1个月以内             | 1-3个月          | 3个月-1年           | 1-5年              | 5年以上              | 不计息               | 合计                |
|---------------------|-------------------|----------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 资产                  |                   |                |                  |                   |                   |                   |                   |
| 货币资金                | 1,964,055,437.97  | -              | -                | -                 | -                 | -                 | 1,964,055,437.97  |
| 结算备付金               | 45,478,725.86     | -              | -                | -                 | -                 | -                 | 45,478,725.86     |
| 存出保证金               | 11,530,584.33     | -              | -                | -                 | -                 | -                 | 11,530,584.33     |
| 交易性金融资产             | 446,547,804.55    | 314,407,606.58 | 8,818,736,753.34 | 15,836,251,882.12 | 35,287,182,303.13 | 14,526,385,797.73 | 75,229,512,147.45 |
| 应收申购款               | -                 | -              | -                | -                 | -                 | 1,066,853,749.83  | 1,066,853,749.83  |
| 其他资产                | -                 | -              | -                | -                 | -                 | 25.00             | 25.00             |
| 资产总计                | 2,467,612,552.71  | 314,407,606.58 | 8,818,736,753.34 | 15,836,251,882.12 | 35,287,182,303.13 | 15,593,239,572.56 | 78,317,430,670.44 |
| 负债                  |                   |                |                  |                   |                   |                   |                   |
| 应付赎回款               | -                 | -              | -                | -                 | -                 | 685,532,060.97    | 685,532,060.97    |
| 应付管理人报酬             | -                 | -              | -                | -                 | -                 | 20,545,139.34     | 20,545,139.34     |
| 应付托管费               | -                 | -              | -                | -                 | -                 | 7,704,427.26      | 7,704,427.26      |
| 应付清算款               | -                 | -              | -                | -                 | -                 | 445,434,737.45    | 445,434,737.45    |
| 卖出回购金融资产款           | 5,938,739,164.13  | -              | -                | -                 | -                 | -                 | 5,938,739,164.13  |
| 应付销售服务费             | -                 | -              | -                | -                 | -                 | 2,046,223.30      | 2,046,223.30      |
| 应交税费                | -                 | -              | -                | -                 | -                 | 750,586.57        | 750,586.57        |
| 其他负债                | -                 | -              | -                | -                 | -                 | 7,942,243.99      | 7,942,243.99      |
| 负债总计                | 5,938,739,164.13  | -              | -                | -                 | -                 | 1,169,955,418.88  | 7,108,694,583.01  |
| 利率敏感度缺口             | -3,471,126,611.42 | 314,407,606.58 | 8,818,736,753.34 | 15,836,251,882.12 | 35,287,182,303.13 | -                 | -                 |
| 上年度末<br>2025年12月31日 | 1个月以内             | 1-3个月          | 3个月-1年           | 1-5年              | 5年以上              | 不计息               | 合计                |
| 资产                  |                   |                |                  |                   |                   |                   |                   |
| 货币资金                | 141,004,805.      | -              | -                | -                 | -                 | -                 | 141,004,805.      |

|           |                   |            |                  |                   |                    |                  |                   |
|-----------|-------------------|------------|------------------|-------------------|--------------------|------------------|-------------------|
|           | 74                |            |                  |                   |                    |                  | 74                |
| 结算备付金     | 59,311,263.51     | -          | -                | -                 | -                  | -                | 59,311,263.51     |
| 存出保证金     | 6,438,846.31      | -          | -                | -                 | -                  | -                | 6,438,846.31      |
| 交易性金融资产   | 20,486,433.97     | 610,512.00 | 2,869,892,875.27 | 11,638,022,313.45 | 19,136,586,5607.49 | 6,151,027,851.98 | 39,816,626,494.16 |
| 买入返售金融资产  | 700,031,716.93    | -          | -                | -                 | -                  | -                | 700,031,716.93    |
| 应收申购款     | -                 | -          | -                | -                 | -                  | 434,734,536.49   | 434,734,536.49    |
| 应收清算款     | -                 | -          | -                | -                 | -                  | 469,023,578.31   | 469,023,578.31    |
| 资产总计      | 927,273,066.46    | 610,512.00 | 2,869,892,875.27 | 11,638,022,313.45 | 19,136,586,5607.49 | 7,054,785,966.78 | 41,627,171,241.45 |
| 负债        |                   |            |                  |                   |                    |                  |                   |
| 应付赎回款     | -                 | -          | -                | -                 | -                  | 178,827,737.17   | 178,827,737.17    |
| 应付管理人报酬   | -                 | -          | -                | -                 | -                  | 9,502,111.10     | 9,502,111.10      |
| 应付托管费     | -                 | -          | -                | -                 | -                  | 3,563,291.65     | 3,563,291.65      |
| 应付清算款     | -                 | -          | -                | -                 | -                  | 245,634,758.68   | 245,634,758.68    |
| 卖出回购金融资产款 | 7,675,884,005.39  | -          | -                | -                 | -                  | -                | 7,675,884,005.39  |
| 应付销售服务费   | -                 | -          | -                | -                 | -                  | 798,916.04       | 798,916.04        |
| 应交税费      | -                 | -          | -                | -                 | -                  | 141,119.33       | 141,119.33        |
| 其他负债      | -                 | -          | -                | -                 | -                  | 5,625,052.29     | 5,625,052.29      |
| 负债总计      | 7,675,884,005.39  | -          | -                | -                 | -                  | 444,092,986.26   | 8,119,976,991.65  |
| 利率敏感度缺口   | -6,748,610,938.93 | 610,512.00 | 2,869,892,875.27 | 11,638,022,313.45 | 19,136,586,5607.49 | -                | -                 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                    |                             |                   |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |                    | 本期末（2026年6月30日）             | 上年度末（2025年12月31日） |
|    | 市场利率上升25个          | -751,336,729.27             | -336,076,365.29   |

|  |               |                   |                   |
|--|---------------|-------------------|-------------------|
|  | 基点            |                   |                   |
|  | 市场利率下降 25 个基点 | 776, 475, 425. 51 | 342, 792, 144. 70 |

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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6. 4. 13. 4. 3. 1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2025年12月31日  |                  |
|---------------|------------------------|------------------|----------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                 | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 14, 526, 385, 797. 73  | 20. 40           | 6, 151, 027, 851. 98 | 18. 36           |
| 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            | 14, 526, 385, 797. 73  | 20. 40           | 6, 151, 027, 851. 98 | 18. 36           |

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<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                         | 本期末（2026 年 6 月 30 日）            | 上年度末（2025 年 12 月 31 日） |



|  |                   |                   |                 |
|--|-------------------|-------------------|-----------------|
|  | 沪深 300 指数上升<br>5% | 1,268,894,198.57  | 823,023,725.27  |
|  | 沪深 300 指数下降<br>5% | -1,268,894,198.57 | -823,023,725.27 |

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>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 20,070,437,174.55      | 10,460,833,301.59        |
| 第二层次          | 55,159,074,972.90      | 29,301,537,086.35        |
| 第三层次          | -                      | 54,256,106.22            |
| 合计            | 75,229,512,147.45      | 39,816,626,494.16        |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额                | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|-------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 14,526,385,797.73 | 18.55         |
|    | 其中：股票             | 14,526,385,797.73 | 18.55         |
| 2  | 基金投资              | —                 | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 60,703,126,349.72 | 77.51         |
|    | 其中：债券             | 60,703,126,349.72 | 77.51         |
|    | 资产支持证券            | —                 | —             |
| 4  | 贵金属投资             | —                 | —             |
| 5  | 金融衍生品投资           | —                 | —             |
| 6  | 买入返售金融资产          | —                 | —             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —                 | —             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 2,009,534,163.83  | 2.57          |
| 8  | 其他各项资产            | 1,078,384,359.16  | 1.38          |
| 9  | 合计                | 78,317,430,670.44 | 100.00        |

## 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              | 246,620,886.00    | 0.35          |
| C  | 制造业              | 12,509,560,817.78 | 17.57         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —                 | —             |
| E  | 建筑业              | —                 | —             |
| F  | 批发和零售业           | —                 | —             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —                 | —             |
| H  | 住宿和餐饮业           | —                 | —             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,770,204,093.95  | 2.49          |
| J  | 金融业              | —                 | —             |
| K  | 房地产业             | —                 | —             |
| L  | 租赁和商务服务业         | —                 | —             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —                 | —             |

|   |               |                       |        |
|---|---------------|-----------------------|--------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -                     | -      |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -                     | -      |
| P | 教育            | -                     | -      |
| Q | 卫生和社会工作       | -                     | -      |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -                     | -      |
| S | 综合            | -                     | -      |
|   | 合计            | 14, 526, 385, 797. 73 | 20. 40 |

注：报告期末，本基金因证券市值波动出现投资比例被动超标，已在法规及合同规定的期限内调整达标。

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  | 300308 | 中际旭创 | 1, 847, 200  | 2, 345, 944, 000. 00 | 3. 29        |
| 2  | 300502 | 新易盛  | 3, 542, 967  | 2, 150, 580, 969. 00 | 3. 02        |
| 3  | 688256 | 寒武纪  | 708, 180     | 1, 129, 936, 599. 00 | 1. 59        |
| 4  | 688498 | 源杰科技 | 528, 739     | 997, 201, 754. 00    | 1. 40        |
| 5  | 688347 | 华虹宏力 | 2, 723, 148  | 915, 794, 672. 40    | 1. 29        |
| 6  | 600183 | 生益科技 | 4, 887, 293  | 847, 456, 606. 20    | 1. 19        |
| 7  | 601138 | 工业富联 | 11, 687, 749 | 843, 271, 090. 35    | 1. 18        |
| 8  | 002384 | 东山精密 | 2, 762, 900  | 724, 846, 815. 00    | 1. 02        |
| 9  | 688981 | 中芯国际 | 3, 954, 392  | 628, 036, 537. 44    | 0. 88        |
| 10 | 300274 | 阳光电源 | 2, 746, 232  | 436, 705, 812. 64    | 0. 61        |
| 11 | 688141 | 杰华特  | 1, 957, 768  | 300, 517, 388. 00    | 0. 42        |
| 12 | 002008 | 大族激光 | 1, 945, 575  | 292, 050, 263. 25    | 0. 41        |
| 13 | 300661 | 圣邦股份 | 1, 934, 725  | 277, 594, 343. 00    | 0. 39        |
| 14 | 002290 | 禾盛新材 | 2, 803, 800  | 257, 585, 106. 00    | 0. 36        |
| 15 | 688409 | 富创精密 | 829, 346     | 253, 987, 212. 50    | 0. 36        |
| 16 | 601899 | 紫金矿业 | 9, 809, 900  | 246, 620, 886. 00    | 0. 35        |
| 17 | 002552 | 宝鼎科技 | 3, 895, 300  | 237, 613, 300. 00    | 0. 33        |
| 18 | 300408 | 三环集团 | 1, 371, 400  | 228, 886, 660. 00    | 0. 32        |
| 19 | 688368 | 晶丰明源 | 1, 027, 320  | 222, 435, 326. 40    | 0. 31        |
| 20 | 300604 | 长川科技 | 641, 600     | 219, 055, 072. 00    | 0. 31        |
| 21 | 002436 | 兴森科技 | 3, 324, 600  | 169, 388, 370. 00    | 0. 24        |
| 22 | 603256 | 宏和科技 | 587, 900     | 155, 987, 507. 00    | 0. 22        |
| 23 | 301511 | 德福科技 | 1, 016, 300  | 146, 194, 755. 00    | 0. 21        |
| 24 | 688052 | 纳芯微  | 406, 905     | 117, 314, 780. 55    | 0. 16        |
| 25 | 002353 | 杰瑞股份 | 750, 700     | 114, 481, 750. 00    | 0. 16        |

|    |        |      |           |                |      |
|----|--------|------|-----------|----------------|------|
| 26 | 603936 | 博敏电子 | 4,092,200 | 109,302,662.00 | 0.15 |
| 27 | 600362 | 江西铜业 | 2,337,000 | 101,192,100.00 | 0.14 |
| 28 | 000070 | 特发信息 | 2,706,500 | 56,403,460.00  | 0.08 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额       | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 601138 | 工业富联 | 980,090,105.21 | 2.93           |
| 2  | 688256 | 寒武纪  | 970,983,394.51 | 2.90           |
| 3  | 300274 | 阳光电源 | 692,329,988.01 | 2.07           |
| 4  | 688347 | 华虹宏力 | 648,668,895.48 | 1.94           |
| 5  | 300308 | 中际旭创 | 585,892,201.10 | 1.75           |
| 6  | 002837 | 英维克  | 553,175,597.51 | 1.65           |
| 7  | 300502 | 新易盛  | 540,231,967.26 | 1.61           |
| 8  | 688981 | 中芯国际 | 535,471,972.18 | 1.60           |
| 9  | 300548 | 长芯博创 | 430,723,866.88 | 1.29           |
| 10 | 601318 | 中国平安 | 411,958,404.59 | 1.23           |
| 11 | 301018 | 申菱环境 | 395,088,581.05 | 1.18           |
| 12 | 600183 | 生益科技 | 378,987,983.68 | 1.13           |
| 13 | 002916 | 深南电路 | 359,366,163.33 | 1.07           |
| 14 | 300394 | 天孚通信 | 334,540,537.00 | 1.00           |
| 15 | 688041 | 海光信息 | 303,765,917.82 | 0.91           |
| 16 | 601899 | 紫金矿业 | 298,793,048.61 | 0.89           |
| 17 | 300757 | 罗博特科 | 289,521,328.91 | 0.86           |
| 18 | 300857 | 协创数据 | 281,454,149.39 | 0.84           |
| 19 | 603626 | 科森科技 | 258,555,707.47 | 0.77           |
| 20 | 002008 | 大族激光 | 257,119,383.75 | 0.77           |

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额       | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 688195 | 腾景科技 | 507,095,064.41 | 1.51           |
| 2  | 002837 | 英维克  | 502,643,173.11 | 1.50           |
| 3  | 301018 | 申菱环境 | 462,880,952.93 | 1.38           |
| 4  | 301550 | 斯菱智驱 | 457,666,657.05 | 1.37           |
| 5  | 688256 | 寒武纪  | 442,480,956.60 | 1.32           |
| 6  | 601138 | 工业富联 | 430,233,723.35 | 1.28           |
| 7  | 300548 | 长芯博创 | 427,188,130.47 | 1.27           |
| 8  | 002384 | 东山精密 | 383,590,890.38 | 1.14           |
| 9  | 300757 | 罗博特科 | 380,852,855.81 | 1.14           |
| 10 | 002916 | 深南电路 | 377,187,887.42 | 1.13           |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 367,906,065.85 | 1.10           |

|    |        |      |                |      |
|----|--------|------|----------------|------|
| 12 | 301377 | 鼎泰高科 | 364,821,165.99 | 1.09 |
| 13 | 603179 | 新泉股份 | 346,633,938.69 | 1.03 |
| 14 | 300394 | 天孚通信 | 323,829,620.73 | 0.97 |
| 15 | 688041 | 海光信息 | 315,406,042.14 | 0.94 |
| 16 | 603626 | 科森科技 | 305,311,581.84 | 0.91 |
| 17 | 300857 | 协创数据 | 295,063,315.76 | 0.88 |
| 18 | 688498 | 源杰科技 | 292,178,065.14 | 0.87 |
| 19 | 002602 | 世纪华通 | 281,080,239.51 | 0.84 |
| 20 | 600418 | 江淮汽车 | 262,854,464.62 | 0.78 |

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 | 18,224,179,109.04 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 15,273,519,696.84 |

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      | 12,000,840,074.56 | 16.85        |
| 2  | 央行票据      | -                 | -            |
| 3  | 金融债券      | 41,243,289,442.43 | 57.92        |
|    | 其中：政策性金融债 | 16,430,449,575.34 | 23.07        |
| 4  | 企业债券      | 1,914,945,455.91  | 2.69         |
| 5  | 企业短期融资券   | -                 | -            |
| 6  | 中期票据      | -                 | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 5,544,051,376.82  | 7.79         |
| 8  | 同业存单      | -                 | -            |
| 9  | 其他        | -                 | -            |
| 10 | 合计        | 60,703,126,349.72 | 85.25        |

#### 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  | 250220   | 25 国开 20   | 40,500,000 | 4,139,985,452.05 | 5.81         |
| 2  | 260005   | 26 付息国债 05 | 31,300,000 | 3,155,012,331.49 | 4.43         |
| 3  | 250215   | 25 国开 15   | 27,100,000 | 2,684,221,589.04 | 3.77         |
| 4  | 260010   | 26 付息国债 10 | 25,200,000 | 2,524,275,782.61 | 3.54         |
| 5  | 09240202 | 24 国开清发 02 | 24,600,000 | 2,483,821,561.64 | 3.49         |

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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

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

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

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 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 | 11,530,584.33    |
| 2  | 应收清算款 | -                |
| 3  | 应收股利  | -                |
| 4  | 应收利息  | -                |
| 5  | 应收申购款 | 1,066,853,749.83 |
| 6  | 其他应收款 | 25.00            |
| 7  | 待摊费用  | -                |
| 8  | 其他    | -                |
| 9  | 合计    | 1,078,384,359.16 |

7.11.4 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  | 113052 | 兴业转债    | 2,190,726,675.91 | 3.08          |
| 2  | 127045 | 牧原转债    | 691,464,711.69   | 0.97          |
| 3  | 113056 | 重银转债    | 487,976,240.17   | 0.69          |
| 4  | 127089 | 晶澳转债    | 456,912,027.81   | 0.64          |
| 5  | 113053 | 隆 22 转债 | 444,747,837.92   | 0.62          |
| 6  | 123107 | 温氏转债    | 279,312,172.01   | 0.39          |
| 7  | 113042 | 上银转债    | 250,464,784.16   | 0.35          |
| 8  | 127050 | 麒麟转债    | 222,460,486.38   | 0.31          |
| 9  | 127084 | 柳工转 2   | 76,203,962.56    | 0.11          |
| 10 | 110087 | 天业转债    | 57,927,372.37    | 0.08          |
| 11 | 127110 | 广核转债    | 47,734,842.60    | 0.07          |
| 12 | 113696 | 伯 25 转债 | 44,777,200.00    | 0.06          |
| 13 | 127030 | 盛虹转债    | 37,381,762.85    | 0.05          |
| 14 | 113066 | 平煤转债    | 18,645,760.74    | 0.03          |
| 15 | 110075 | 南航转债    | 17,224,986.18    | 0.02          |
| 16 | 127049 | 希望转 2   | 15,878,782.93    | 0.02          |
| 17 | 128134 | 鸿路转债    | 11,738,008.93    | 0.02          |
| 18 | 113634 | 珀莱转债    | 10,844,479.96    | 0.02          |
| 19 | 118051 | 皓元转债    | 10,630,103.26    | 0.01          |
| 20 | 127046 | 百润转债    | 8,365,467.40     | 0.01          |
| 21 | 113655 | 欧 22 转债 | 6,953,441.87     | 0.01          |
| 22 | 110090 | 爱迪转债    | 6,058,169.73     | 0.01          |
| 23 | 118042 | 奥维转债    | 5,928,051.40     | 0.01          |
| 24 | 113043 | 财通转债    | 5,596,538.31     | 0.01          |
| 25 | 113659 | 莱克转债    | 5,364,685.07     | 0.01          |
| 26 | 118024 | 冠宇转债    | 4,383,228.11     | 0.01          |
| 27 | 113661 | 福 22 转债 | 3,052,325.07     | 0.00          |
| 28 | 110093 | 神马转债    | 2,982,186.16     | 0.00          |
| 29 | 113650 | 博 22 转债 | 2,640,074.70     | 0.00          |
| 30 | 127104 | 姚记转债    | 1,682,179.03     | 0.00          |
| 31 | 123138 | 丝路转债    | 1,671,802.29     | 0.00          |
| 32 | 113688 | 国检转债    | 1,589,740.48     | 0.00          |
| 33 | 118031 | 天 23 转债 | 1,472,991.10     | 0.00          |
| 34 | 113647 | 禾丰转债    | 1,276,071.25     | 0.00          |
| 35 | 123196 | 正元转 02  | 1,032,697.11     | 0.00          |
| 36 | 123259 | 锦浪转 02  | 927,533.18       | 0.00          |
| 37 | 118022 | 锂科转债    | 752,029.81       | 0.00          |
| 38 | 127070 | 大中转债    | 749,385.20       | 0.00          |
| 39 | 118030 | 睿创转债    | 698,044.65       | 0.00          |
| 40 | 127088 | 赫达转债    | 680,725.23       | 0.00          |
| 41 | 123263 | 鼎捷转债    | 652,597.09       | 0.00          |
| 42 | 123158 | 宙邦转债    | 554,268.79       | 0.00          |

|    |        |         |            |      |
|----|--------|---------|------------|------|
| 43 | 123165 | 回天转债    | 532,726.26 | 0.00 |
| 44 | 113666 | 爱玛转债    | 530,951.62 | 0.00 |
| 45 | 123109 | 昌红转债    | 522,637.65 | 0.00 |
| 46 | 123252 | 银邦转债    | 507,817.79 | 0.00 |
| 47 | 118060 | 瑞可转债    | 483,077.93 | 0.00 |
| 48 | 123261 | 普联转债    | 480,984.85 | 0.00 |
| 49 | 110076 | 华海转债    | 467,127.96 | 0.00 |
| 50 | 110085 | 通 22 转债 | 422,055.42 | 0.00 |
| 51 | 113673 | 岱美转债    | 215,154.34 | 0.00 |
| 52 | 118056 | 路维转债    | 148,039.79 | 0.00 |
| 53 | 127031 | 洋丰转债    | 132,866.53 | 0.00 |
| 54 | 118053 | 正帆转债    | 93,663.48  | 0.00 |
| 55 | 113648 | 巨星转债    | 91,736.12  | 0.00 |
| 56 | 118059 | 颀中转债    | 87,218.57  | 0.00 |
| 57 | 113667 | 春 23 转债 | 35,530.93  | 0.00 |
| 58 | 118062 | 天准转债    | 28,081.63  | 0.00 |
| 59 | 110099 | 福能转债    | 14,042.44  | 0.00 |
| 60 | 113643 | 风语转债    | 9,259.57   | 0.00 |

7.11.5 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。

7.11.6 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<br>户数<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构             |                       |                |                       |
|------------------------|------------------|---------------|-------------------|-----------------------|----------------|-----------------------|
|                        |                  |               | 机构投资者             |                       | 个人投资者          |                       |
|                        |                  |               | 持有份额              | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) | 持有份额           | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) |
| 景顺长城<br>景颐丰利<br>债券 A 类 | 53,723           | 255,692.29    | 12,823,729,055.79 | 93.35                 | 912,827,704.72 | 6.65                  |
| 景顺长城<br>景颐丰利<br>债券 C 类 | 136,421          | 27,765.80     | 2,904,908,595.59  | 76.69                 | 882,929,805.68 | 23.31                 |
| 景顺长城<br>景颐丰利           | 8,908            | 2,698,141.88  | 23,840,256,716.47 | 99.19                 | 194,791,163.41 | 0.81                  |



|        |         |            |                   |       |                  |      |
|--------|---------|------------|-------------------|-------|------------------|------|
| 债券 F 类 |         |            |                   |       |                  |      |
| 合计     | 199,052 | 208,786.86 | 39,568,894,367.85 | 95.21 | 1,990,548,673.81 | 4.79 |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别           | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|----------------|--------------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 景顺长城景颐丰利债券 A 类 | 1,781,255.04 | 0.012967    |
|                  | 景顺长城景颐丰利债券 C 类 | 1,567,946.63 | 0.041394    |
|                  | 景顺长城景颐丰利债券 F 类 | 120,752.47   | 0.000502    |
|                  | 合计             | 3,469,954.14 | 0.008349    |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别           | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|----------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 景顺长城景颐丰利债券 A 类 | 0~10              |
|                                | 景顺长城景颐丰利债券 C 类 | >100              |
|                                | 景顺长城景颐丰利债券 F 类 | —                 |
|                                | 合计             | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 景顺长城景颐丰利债券 A 类 | 50~100            |
|                                | 景顺长城景颐丰利债券 C 类 | —                 |
|                                | 景顺长城景颐丰利债券 F 类 | —                 |
|                                | 合计             | 50~100            |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 景顺长城景颐丰利债券 A 类    | 景顺长城景颐丰利债券 C 类   | 景顺长城景颐丰利债券 F 类    |
|--------------------------------|-------------------|------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2017 年 1 月 18 日）基金份额总额 | 24,059,083.84     | 250,628,555.56   | —                 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 6,689,575,515.41  | 1,877,705,391.93 | 13,727,902,877.36 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 14,026,097,098.87 | 4,353,381,986.30 | 27,961,032,190.47 |
| 减：本报告期                         | 6,979,115,853.77  | 2,443,248,976.96 | 17,653,887,187.95 |

|                  |                       |                      |                       |
|------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|
| 基金总赎回份<br>额      |                       |                      |                       |
| 本报告期基金<br>拆分变动份额 | -                     | -                    | -                     |
| 本报告期期末<br>基金份额总额 | 13, 736, 556, 760. 51 | 3, 787, 838, 401. 27 | 24, 035, 047, 879. 88 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金托管人受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

## 10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 交易单元数量 | 股票交易             |                  | 应支付该券商的佣金    |                | 备注       |
|--------------|--------|------------------|------------------|--------------|----------------|----------|
|              |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 (%) |          |
| 申万宏源证券有限公司   | 2      | 8,303,009,947.84 | 24.79            | 3,777,884.60 | 24.80          | 未变更      |
| 天风证券股份有限公司   | 1      | 6,340,993,064.49 | 18.93            | 2,885,151.88 | 18.94          | 未变更      |
| 东吴证券股份有限公司   | 2      | 5,491,562,709.49 | 16.39            | 2,498,663.52 | 16.40          | 未变更      |
| 华福证券股份有限公司   | 1      | 5,034,947,405.99 | 15.03            | 2,290,907.97 | 15.04          | 未变更      |
| 国泰海通证券股份有限公司 | 2      | 2,942,261,548.95 | 8.78             | 1,338,731.90 | 8.79           | 未变更      |
| 华鑫证券有限责任公司   | 1      | 1,812,449,128.32 | 5.41             | 824,667.49   | 5.41           | 未变更      |
| 长城证券股份有限公司   | 2      | 1,075,529,043.29 | 3.21             | 489,365.72   | 3.21           | 未变更      |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1      | 805,635,044.62   | 2.41             | 366,563.95   | 2.41           | 未变更      |
| 中信证券股份有限公司   | 2      | 717,209,026.48   | 2.14             | 316,919.66   | 2.08           | 未变更      |
| 兴业证券股份有限公司   | 1      | 527,541,796.48   | 1.57             | 240,031.51   | 1.58           | 本期报告新增1个 |
| 野村东方国际证券有限公司 | 2      | 446,560,089.93   | 1.33             | 203,185.32   | 1.33           | 未变更      |
| 诚通证券股份有限     | 1      | -                | -                | -            | -              | 未变更      |

|                |   |   |   |   |   |                   |
|----------------|---|---|---|---|---|-------------------|
| 公司             |   |   |   |   |   |                   |
| 首创证券股份有限公司     | - | - | - | - | - | 本期报告<br>退租<br>1 个 |
| 中信证券(山东)有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更               |

注：1、基金管理人选择交易单元的标准为：交易单元所属券商财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强。

2、基金管理人选择交易单元参与证券交易的程序为：基金管理人定期对符合上述标准的券商进行测评，测评结果是决定后期使用各证券公司交易单元参与证券交易的依据。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 债券交易             |                  | 债券回购交易            |                    | 权证交易 |                  |
|--------------|------------------|------------------|-------------------|--------------------|------|------------------|
|              | 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 (%) |
| 申万宏源证券有限公司   | 1,279,784,248.05 | 13.72            | 3,851,642,000.00  | 8.56               | -    | -                |
| 天风证券股份有限公司   | 3,834,766,087.93 | 41.10            | 19,908,264,000.00 | 44.24              | -    | -                |
| 东吴证券股份有限公司   | 1,226,478,184.48 | 13.14            | 4,163,013,000.00  | 9.25               | -    | -                |
| 华福证券股份有限公司   | 945,674,830.09   | 10.14            | 1,185,627,000.00  | 2.63               | -    | -                |
| 国泰海通证券股份有限公司 | 927,456,526.62   | 9.94             | 5,949,692,000.00  | 13.22              | -    | -                |
| 华鑫证券有限责任公司   | 325,492,769.36   | 3.49             | -                 | -                  | -    | -                |
| 长城证券股份有限公司   | 1,849,422.99     | 0.02             | 588,251,000.00    | 1.31               | -    | -                |

| 公司             |                |      |                  |       |   |   |
|----------------|----------------|------|------------------|-------|---|---|
| 中国银河证券股份有限公司   | 204,534,311.75 | 2.19 | 1,722,485,000.00 | 3.83  | - | - |
| 中信证券股份有限公司     | 154,634,245.69 | 1.66 | -                | -     | - | - |
| 兴业证券股份有限公司     | 222,272,943.18 | 2.38 | 4,652,656,000.00 | 10.34 | - | - |
| 野村东方国际证券有限公司   | 207,770,896.59 | 2.23 | 2,983,713,000.00 | 6.63  | - | - |
| 诚通证券股份有限公司     | -              | -    | -                | -     | - | - |
| 首创证券股份有限公司     | -              | -    | -                | -     | - | - |
| 中信证券(山东)有限责任公司 | -              | -    | -                | -     | - | - |

### 10.8 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  | 关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增新浪仓石为销售机构的公告     | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 1 月 12 日 |
| 2  | 关于景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金新增嘉实财富为销售机构的公告      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 1 月 20 日 |
| 3  | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 1 月 20 日 |
| 4  | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 1 月 22 日 |
| 5  | 景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告       | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 1 月 22 日 |
| 6  | 关于景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金新增博时财富为销售机构的公告      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 1 月 23 日 |
| 7  | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 1 月 27 日 |
| 8  | 关于景顺长城景颐丰利债券型证券投资                      | 中国证监会指定报刊及   | 2026 年 1 月 30 日 |

|    |                                                |              |                 |
|----|------------------------------------------------|--------------|-----------------|
|    | 资基金新增国信证券为销售机构的公告                              | 网站           |                 |
| 9  | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知                        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 2 月 25 日 |
| 10 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知             | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 2 月 26 日 |
| 11 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增青岛银行为销售机构的公告             | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 3 月 16 日 |
| 12 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知                        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 3 月 25 日 |
| 13 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告             | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 3 月 27 日 |
| 14 | 景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金 2025 年年度报告                   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 3 月 27 日 |
| 15 | 关于景顺长城景颐丰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 | 2026 年 3 月 30 日 |
| 16 | 景顺长城基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 3 月 31 日 |
| 17 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知                        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 4 月 7 日  |
| 18 | 景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告              | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 4 月 21 日 |
| 19 | 景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告               | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 4 月 22 日 |
| 20 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告         | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 4 月 22 日 |
| 21 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东莞证券为销售机构的公告             | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 4 月 23 日 |
| 22 | 关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增中欧财富为销售机构的公告             | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 4 月 28 日 |
| 23 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知                        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 4 月 29 日 |
| 24 | 2025 年度景顺长城基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 4 月 29 日 |
| 25 | 关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增挖财基金为销售机构的               | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 5 月 8 日  |

|    |                                           |              |                 |
|----|-------------------------------------------|--------------|-----------------|
|    | 公告                                        |              |                 |
| 26 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知                   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 5 月 12 日 |
| 27 | 景顺长城基金管理有限公司关于部分基金投顾组合终止的公告               | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 5 月 13 日 |
| 28 | 关于景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金新增华宝证券为销售机构的公告         | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 5 月 19 日 |
| 29 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知                   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 5 月 21 日 |
| 30 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 5 月 22 日 |
| 31 | 景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金 2026 年第 1 号更新招募说明书      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 5 月 23 日 |
| 32 | 景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金基金产品资料概要更新               | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 5 月 23 日 |
| 33 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中邮证券为销售机构的公告        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 5 月 26 日 |
| 34 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知                   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 5 月 27 日 |
| 35 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华泰证券为销售机构的公告        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 6 月 1 日  |
| 36 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知                   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 6 月 2 日  |
| 37 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知                   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 6 月 9 日  |
| 38 | 关于景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金新增金斧子为销售机构的公告          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 6 月 16 日 |
| 39 | 关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增江苏银行苏盈+同业平台为销售平台的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 6 月 23 日 |
| 40 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知                   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 6 月 23 日 |
| 41 | 关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增汇添富财富为销售机构的公告       | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 6 月 25 日 |
| 42 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金调整持有股票估值价格的公告           | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 6 月 26 日 |

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

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日