

景顺长城景颐双利债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 24 日

§1 重要提示

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

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城景颐双利债券
场内简称	无
基金主代码	000385
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 13 日
报告期末基金份额总额	30,515,247,276.70 份
投资目标	本基金主要通过投资于固定收益品种，在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略：本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会，根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略：</p> <p>债券类属资产配置：基金管理人根据国债、金融债、企业（公司）债、分离交易可转债债券部分等品种与同期限国债或央票之间收益率利差的扩大和收窄的分析，主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。</p> <p>债券投资策略：债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极</p>

	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。 资产支持证券投资策略：本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。	
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）+1.5%。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	景顺长城景颐双利债券 A 类	景顺长城景颐双利债券 C 类
下属分级基金的交易代码	000385	000386
报告期末下属分级基金的份额总额	28,646,241,390.21 份	1,869,005,886.49 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日）	
	景顺长城景颐双利债券 A 类	景顺长城景颐双利债券 C 类
1. 本期已实现收益	158,196,893.01	8,386,709.98
2. 本期利润	383,626,157.35	21,961,956.47
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0201	0.0168
4. 期末基金资产净值	45,160,084,116.27	2,852,995,951.76
5. 期末基金份额净值	1.576	1.526

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城景颐双利债券 A 类

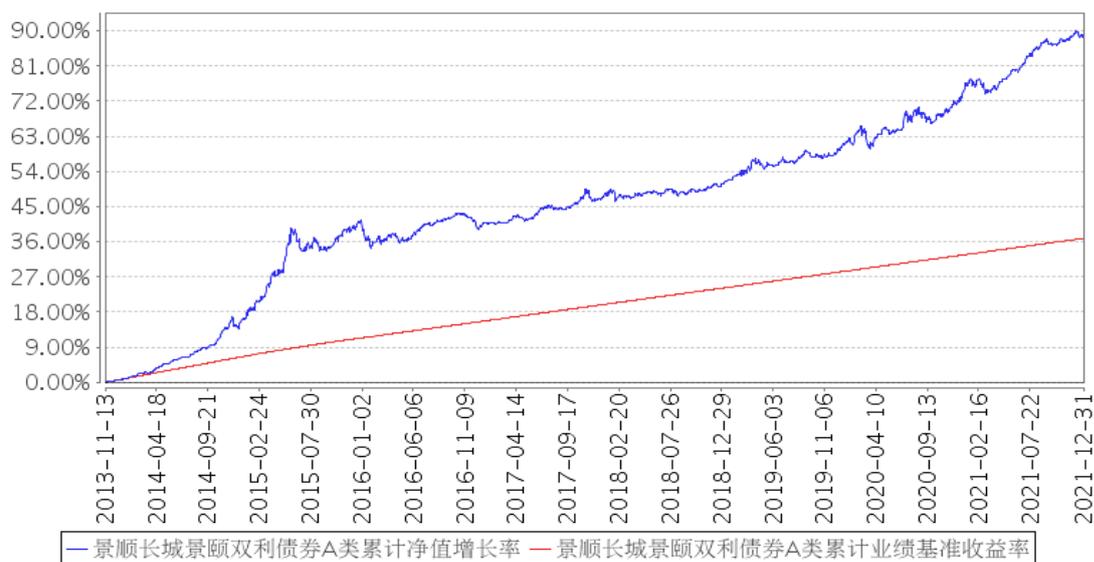
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.32%	0.15%	0.79%	0.01%	0.53%	0.14%
过去六个月	4.24%	0.17%	1.59%	0.01%	2.65%	0.16%
过去一年	8.36%	0.21%	3.20%	0.01%	5.16%	0.20%
过去三年	25.38%	0.24%	10.27%	0.01%	15.11%	0.23%
过去五年	34.86%	0.21%	18.38%	0.01%	16.48%	0.20%
自基金合同生效起至今	89.08%	0.24%	36.87%	0.01%	52.21%	0.23%

景顺长城景颐双利债券 C 类

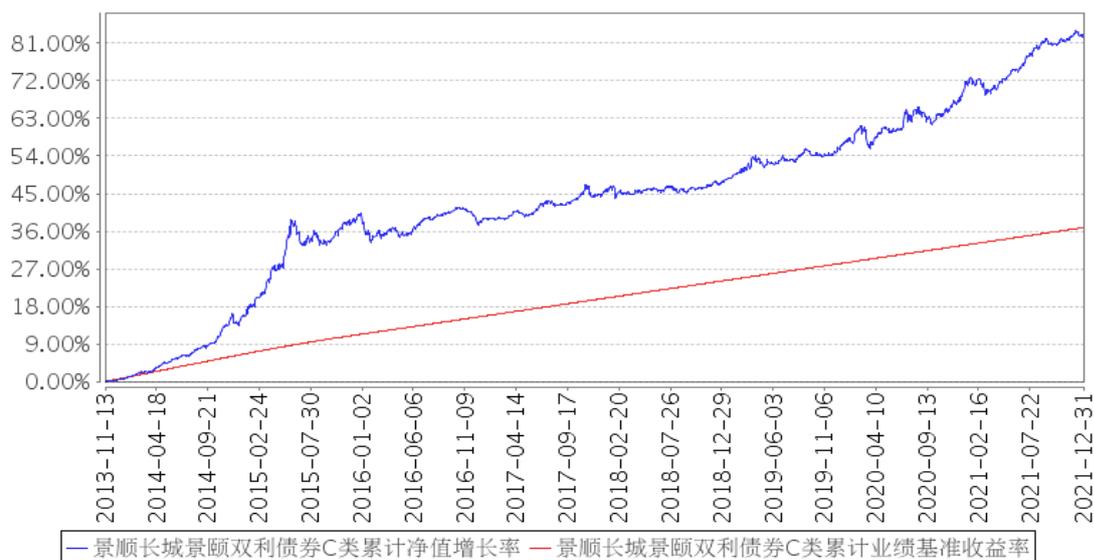
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.24%	0.14%	0.79%	0.01%	0.45%	0.13%
过去六个月	4.05%	0.16%	1.59%	0.01%	2.46%	0.15%
过去一年	7.87%	0.20%	3.20%	0.01%	4.67%	0.19%
过去三年	23.85%	0.23%	10.27%	0.01%	13.58%	0.22%
过去五年	32.16%	0.21%	18.38%	0.01%	13.78%	0.20%
自基金合同生效起至今	83.04%	0.24%	36.87%	0.01%	46.17%	0.23%

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

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



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



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

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
董晗	本基金的基金经理	2020 年 10 月 30 日	-	15 年	理学硕士。曾任易方达基金管理有限公司研究部研究员，国投瑞银基金管理有限公司研究部研究员、投资部基金经理。2020 年 7 月加入本公司，自 2020 年 10 月起担任股票投资部基金经理。具有 15 年证券、基金行业从业经验。
李怡文	本基金的基金经理	2021 年 4 月 30 日	-	15 年	工商管理硕士。曾任国家外汇管理局会计处组合分析师，佛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 15 年证券、基金行业从业经验。
郭杰	本基金的基金经理助理	2021 年 12 月 17 日	-	6 年	金融硕士。曾任太平财产保险有限公司财务部预算审批专员，前海开源基金管理有限公司交易部债券交易员。2016 年 3 月加入本公司，担任交易管理部交易员、固定收益部研究员，现任固定收益部基金经理助理。具有 6 年证券、基金行业从业经验。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少

的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 14 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年四季度中国经济整体延续了三季度以来的回落走势。出口数据高位震荡，11 月份当月出口同比保持 22% 的较高增速，显示出口仍有一定韧劲。内需相对疲软：11 月份社会消费品零售同比增速为 3.9%，增速环比回落 1 个百分点。而房地产销售、投资数据继续走弱：尽管截止 11 月份的当年累计房地产开发投资增速仍保持正增长，单月房地产开发投资增速自 9 月份以来连续出现个位数的同比下滑，单月销售面积和新开工面积也出现双位数下滑。疲弱的房地产投资数据拖累了整个固定资产投资增速。进入四季度以后，前期缺煤缺电现象大幅缓解，工业增加值增速有所反弹，11 月份单月工业增加值增速 3.8%，比 9 月份低点反弹 0.7 个百分点。在整体经济增长乏力的大背景下，宏观经济政策转向稳增长：12 月份先有降准，后有 1 年期 LPR 调降 5BP，12 月份中央经济工作会议也定调 2022 年经济工作要稳字当头、稳中求进，要求各地区各部门要承担起稳定宏观经济的责任。与国内政策转向稳增长相对比，受通胀压力较大的影响，主要海外经济体加快了宽松政策退出：美联储 Taper 加快，将在明年 3 月份结束购债计划，而对于美国首次加息的预期也提前到明年上半年。

债券市场方面，整个四季度资金面保持宽松，债券收益率在 10 月份有所反弹后继续下行，多个期限的收益率创年内低点。整个四季度来看，10 年期国开债收益率回落约 11bp，1 年期国开债收益率回落 8BP，3-5 年回落幅度最大，约 20bp。

权益市场方面，指数先回落后反弹，上证指数四季度小幅上涨，但行业继续分化：传媒军工等行业表现最好，大消费以及新能源相关板块也表现不俗，而受供应放量、价格回落的影响，三季度表现较好的煤炭行业表现垫底。上证指数当季上涨 2.01%，沪深 300 上涨 1.52%，创业板指反弹 2.40%。

四季度本基金债券组合配置继续偏向中低久期的高等级信用债，以及流动性好的中短久期的利率债，组合久期保持在中性偏低的位置。对于股票组合我们进一步加仓，重点增加了前期跌幅较大、估值较为合理的消费股和金融股，以及预期未来景气程度将见底回升的交运、地产股等，股票组合结构较为均衡。

展望未来，中国宏观政策从前期调结构转向稳增长，稳增长的方向既定，政策的力度还需要观察，2022 年一季度形势会更为明朗。前瞻地看，经济出现大幅失速下滑的风险并不大，未来经济逐步企稳并温和回升可能性较大。因此我们对股票市场态度偏积极，股票组合将保持相对较高

配置，并将进一步优化结构。对债券市场保持中性态度，债券组合维持低久期，将耐心等待合适的配置机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2021 年 4 季度，景顺长城景颐双利债券 A 类份额净值增长率为 1.32%，业绩比较基准收益率为 0.79%。

2021 年 4 季度，景顺长城景颐双利债券 C 类份额净值增长率为 1.24%，业绩比较基准收益率为 0.79%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	8,335,538,718.62	17.09
	其中：股票	8,335,538,718.62	17.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	38,756,870,980.98	79.45
	其中：债券	38,756,870,980.98	79.45
	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	509,626,224.45	1.04
	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	512,425,906.60	1.05
8	其他资产	664,604,532.33	1.36
9	合计	48,779,066,362.98	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	904,869,718.02	1.88
C	制造业	4,316,551,472.75	8.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	-	-

	业		
E	建筑业	131,634,900.00	0.27
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	206,649,850.92	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	168,677,579.50	0.35
J	金融业	2,093,147,969.95	4.36
K	房地产业	408,068,211.22	0.85
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	105,939,016.26	0.22
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	8,335,538,718.62	17.36

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	002142	宁波银行	10,032,747	384,053,555.16	0.80
2	000776	广发证券	14,264,474	350,763,415.66	0.73
3	600036	招商银行	6,768,041	329,671,277.11	0.69
4	000568	泸州老窖	1,022,200	259,505,914.00	0.54
5	001979	招商蛇口	19,393,133	258,704,394.22	0.54
6	601225	陕西煤业	21,152,708	258,063,037.60	0.54
7	000001	平安银行	15,640,290	257,751,979.20	0.54
8	000792	盐湖股份	7,240,235	256,231,916.65	0.53
9	600519	贵州茅台	122,400	250,920,000.00	0.52
10	300014	亿纬锂能	2,042,872	241,426,612.96	0.50

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	531,013,923.10	1.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,447,852,000.00	17.59
	其中：政策性金融债	8,175,960,000.00	17.03

4	企业债券	5,741,349,500.00	11.96
5	企业短期融资券	5,338,914,000.00	11.12
6	中期票据	11,256,088,000.00	23.44
7	可转债（可交换债）	3,693,056,557.88	7.69
8	同业存单	97,390,000.00	0.20
9	其他	3,651,207,000.00	7.60
10	合计	38,756,870,980.98	80.72

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	210202	21 国开 02	12,300,000	1,241,070,000.00	2.58
2	210207	21 国开 07	11,000,000	1,111,550,000.00	2.32
3	1728022	17 工商银行二级 02	10,600,000	1,076,112,000.00	2.24
4	200203	20 国开 03	8,800,000	895,576,000.00	1.87
5	132015	18 中油 EB	8,437,750	876,935,357.50	1.83

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或

在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

1、中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”，股票代码：601398），其私人银行部于 2021 年 5 月 10 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书（沪银保监罚决字（2021）54 号）。其因部分理财产品交易存在利益输送，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项的相关规定，被处以 50 万元罚款。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对工商银行进行了投资。

2、宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”，股票代码：002142）于 2021 年 12 月 29 日收到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局出具的行政处罚决定书（甬银保监罚决字（2021）81 号）。其因信用卡业务管理不到位，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条等规定，被处以罚款人民币 30 万元。

2021 年 6 月 10 日，宁波银行因代理销售保险不规范，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、第四十八条第（一）项的相关规定，收到宁波银保监局出具的行政处罚决定书（甬银保监罚决字（2021）36 号），被处以罚款人民币 25 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

2021 年 7 月 30 日，宁波银行因贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储、开发贷款支用审核不严、房地产贷款放款和支用环节审核不严、贷款资金违规流入房市、房地产贷款资金回流借款人、票据业务开展不审慎，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条的规定，收到宁波银保监局出具的行政处罚决定书（甬银保监罚决字（2021）57 号），被处以罚款人民币 275 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

2021 年 7 月 13 日，宁波银行因违规为存款人多头开立银行结算账户、超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料等，收到中国人民银行宁波市中心支行出具的行政处罚决定书（甬银处罚字（2021）2 号），被给予警告，并处罚款 286.2 万元。

2021 年 7 月 13 日，宁波银行因违反规定办理经常项目外汇业务、违反规定办理资本项目资金收付，收到外管局宁波分局出具的行政处罚决定书（甬外管罚（2021）7 号），被罚款 100 万，没收违法所得 104.85 万元。

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宁波银行进行了投资。

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

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

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对招商银行进行了投资。

4、2021 年 5 月 28 日，平安银行收到中国银保监会云南监管局出具的行政处罚决定书（云银保监罚决字〔2021〕34 号），其因利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险等违法违规事实，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项相关规定，被处以罚款人民币 210 万元。

2021 年 5 月 10 日，平安银行资金运营中心收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书（沪银保监罚决字〔2021〕55 号），其因违规向未取得土地使用权证的房地产项目提供融资等违法违规事实，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项相关规定，被处以罚款人民币 300 万元。

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平安银行进行了投资。

5、青海盐湖工业股份有限公司（以下简称“盐湖股份”，股票代码：000792）于 2021 年 9 月 28 日收到国家市场监督管理总局出具的行政处罚决定书（市监处罚【2021】71 号），其因在生产成本未发生显著变化的情况下，大幅度上调销售价格，违反了《中华人民共和国价格法》第十四条第（三）项的规定，被处以 160 万元罚款。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对盐湖股份进行了投资。

6、其余五名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,269,056.56
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	531,217,354.90
5	应收申购款	128,118,120.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	664,604,532.33

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	132015	18 中油 EB	876,935,357.50	1.83
2	110053	苏银转债	850,024,828.40	1.77
3	113011	光大转债	644,035,465.80	1.34
4	113044	大秦转债	516,186,892.80	1.08
5	123107	温氏转债	122,137,462.88	0.25
6	132009	17 中油 EB	72,837,187.20	0.15
7	127020	中金转债	63,155,233.23	0.13
8	113021	中信转债	52,699,165.40	0.11
9	110073	国投转债	42,740,754.00	0.09
10	110059	浦发转债	40,147,000.00	0.08
11	127018	本钢转债	39,167,564.67	0.08
12	113042	上银转债	20,158,186.90	0.04
13	113563	柳药转债	17,266,573.20	0.04
14	110075	南航转债	16,742,028.00	0.03
15	113037	紫银转债	14,486,991.90	0.03
16	128129	青农转债	11,585,373.03	0.02
17	128048	张行转债	10,253,923.55	0.02
18	128029	太阳转债	8,061,076.80	0.02
19	123111	东财转 3	7,571,463.60	0.02
20	113024	核建转债	5,929,465.60	0.01
21	128136	立讯转债	5,854,547.40	0.01
22	113050	南银转债	5,627,299.20	0.01
23	113047	旗滨转债	5,003,588.00	0.01
24	128034	江银转债	2,781,084.15	0.01
25	110079	杭银转债	2,502,008.60	0.01
26	113043	财通转债	2,429,800.00	0.01
27	127025	冀东转债	2,376,600.00	0.00
28	110048	福能转债	2,305,690.20	0.00
29	123096	思创转债	2,279,132.73	0.00
30	128097	奥佳转债	2,230,088.90	0.00
31	110067	华安转债	1,132,380.20	0.00

32	123108	乐普转 2	895,634.72	0.00
33	113602	景 20 转债	442,951.50	0.00
34	132022	20 广版 EB	365,750.00	0.00
35	110045	海澜转债	233,960.00	0.00
36	128123	国光转债	217,599.48	0.00
37	128119	龙大转债	177,914.10	0.00
38	113623	凤 21 转债	125,870.00	0.00
39	128114	正邦转债	69,804.36	0.00

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项 目	景顺长城景颐双利债券 A 类	景顺长城景颐双利债券 C 类
报告期期初基金份额总额	11,420,529,243.58	892,273,913.49
报告期期间基金总申购份额	19,038,058,491.07	1,208,344,380.58
减：报告期期间基金总赎回份额	1,812,346,344.44	231,612,407.58
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	28,646,241,390.21	1,869,005,886.49

注：总申购份额含转换入及红利再投资份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本期末未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期末未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2022 年 1 月 24 日