

景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数证
券投资基金
2024 年第 4 季度报告

2024 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：杭州银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 1 月 22 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。

基金托管人杭州银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2024 年 10 月 1 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数
基金主代码	018137
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 6 月 14 日
报告期末基金份额总额	8,316,173,919.95 份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金为被动式指数基金，采用抽样复制和动态最优化的方法，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的债券，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数</p>

	<p>化的投资组合。本基金跟踪标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于本基金非现金基金资产的 80%。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金将对标的指数采用抽样复制法和动态最优化的方式进行投资，在综合考虑跟踪效果、操作风险、投资可行性等因素的基础上构建收益特性与标的指数收益率高度相关的投资组合，并根据基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间债券市场交易特性等情况，对投资组合进行优化调整。</p> <p>3、国债期货投资策略</p> <p>本基金以提高对利率风险管理能力，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则参与国债期货投资。</p>	
业绩比较基准	中债-0-3 年政策性金融债指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率（税后） \times 5%	
风险收益特征	本基金为债券型指数基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。同时，本基金为指数型基金，本基金主要投资于标的指数成份券及其备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	杭州银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数 A	景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数 C
下属分级基金的交易代码	018137	018138
报告期末下属分级基金的份额总额	8,030,845,424.87 份	285,328,495.08 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（2024 年 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 日）	
	景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数 A	景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数 C
1. 本期已实现收益	69,535,079.95	1,277,699.64
2. 本期利润	136,998,801.30	1,752,099.55
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0195	0.0181
4. 期末基金资产净值	8,433,740,072.47	301,090,475.71
5. 期末基金份额净值	1.0501	1.0552

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数 A

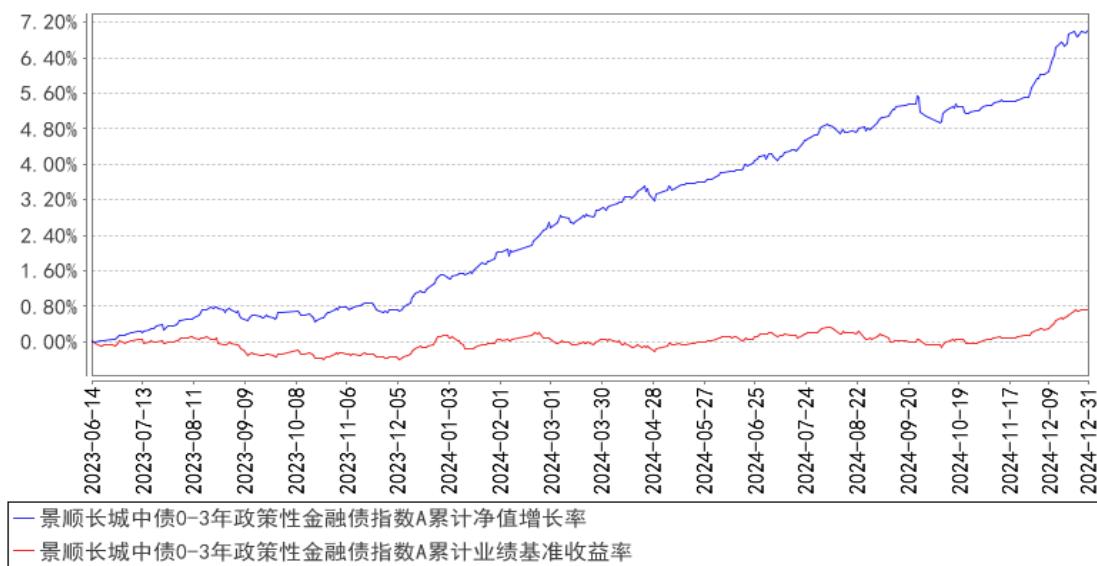
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.83%	0.07%	0.78%	0.03%	1.05%	0.04%
过去六个月	2.70%	0.07%	0.56%	0.03%	2.14%	0.04%
过去一年	5.40%	0.06%	0.56%	0.03%	4.84%	0.03%
自基金合同生效起至今	7.01%	0.05%	0.72%	0.03%	6.29%	0.02%

景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数 C

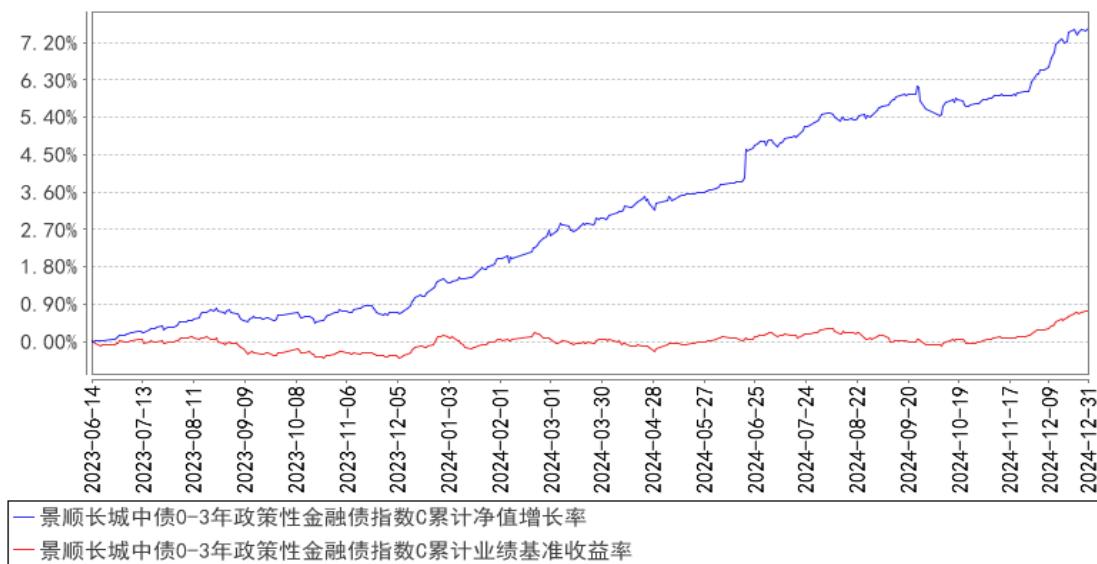
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.83%	0.07%	0.78%	0.03%	1.05%	0.04%
过去六个月	2.58%	0.07%	0.56%	0.03%	2.02%	0.04%
过去一年	5.94%	0.07%	0.56%	0.03%	5.38%	0.04%
自基金合同生效起至今	7.53%	0.06%	0.72%	0.03%	6.81%	0.03%

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

景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数 A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数 C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于待偿期 0 年-3 年（包含 3 年）的标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的建仓期为自 2023 年 6 月 14 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		
米良	本基金的基金经理	2023 年 6 月 14 日	-	10 年	经济学硕士, CFA。曾任汇丰银行（中国）有限公司零售银行部管理培训生、零售银行部高级客户经理, 汇丰银行深圳分行贸易融资部产品经理, 招商银行资产负债部资产管理岗。2018 年 9 月加入本公司, 自 2018 年 11 月起担任固定收益部基金经理。具有 10 年证券、基金行业从业经验。
曹怡	本基金的基金助理	2023 年 8 月 19 日	-	6 年	理学硕士。2018 年 8 月加入本公司, 历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、《景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数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 3 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要而发生的同日反向交易。

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

“924”一揽子增量逆周期刺激政策加码以来，四季度宏观经济基本面企稳回升，其中需求端的消费以及生产端的服务业生产指数回升尤其明显，市场微观主体信心有所改善，地产销售也出现了明显的回暖。叠加前期一直偏紧缩的财政支出力度在四季度大幅扩张，进一步助力宏观经济基本面持续改善，全年经济社会发展主要目标任务将顺利完成。四季度宏观数据方面，居民消费和地产销售成为经济两大亮点。居民消费回暖，10、11 两个月社零平均增速 3.9%相比新政前三个季度平均 2.7%的增速明显改善，其中受“以旧换新”政策支持的品类，包括家电、汽车等，改善尤其明显。房地产销售大幅改善，其中一线城市的房价率先企稳回升，连续两个月实现了环比 0.4%的正增长，“926”政治局会议首次提出“要促进房地产市场止跌回稳”、“1209”政治局会议再提出“稳住楼市股市”，一线城市的房价有望率先打出示范效应。

四季度，市场流动性整体保持宽裕，央行通过多种货币政策工具维持资金面相对平稳，但资金中枢仍保持高位。四季度，对市场流动性扰动因素除一些季节性因素外，政府债集中发行也阶段性对资金面产生一定影响。11 月 8 日全国人大常委会批准增加 6 万亿元地方政府债务限额，其中年内将 2024 年 2 万亿额度集中在 11、12 月发行完毕，因此对四季度的资金面造成一定考验。从对冲手段来看，央行当季并未进行降准降息操作，同时在公开市场操作方面也较为克制，表现为 OMO 投放规模较前期明显减小，仅在 10 月中下旬缴税期间大额投放万亿元，同时 MLF 余额也从三季度末的 68780 亿元下降至当前 50890 亿元，当季共计回笼近 1.8 万亿。除传统货币政策工具外，央行在创新工具方面态度更为积极，四季度在国债买卖方面共计净买入国债 7000 亿元；另外在 10 月 28 日央行公告启用公开市场买断式逆回购操作工具，当季在买断式回购操作上央行共计净投放 2.7 万亿元。创新型货币政策工具的使用，有效补充了因 MLF 缩量和再融资债集中发行造成的流动性缺口，因此四季度银行间流动性整体上并未明显收敛。从价格角度来看，受政府债发行的阶段性扰动以及在美元指数走高后人民币汇率承压影响，DR007 月均值分别为 1.66%、1.67%

和 1.71%，资金中枢较三季度明显下行，但仍处于政策利率之上。

四季度，更为重要的货币政策方面的变化是 12 月初政治局会议以及中央经济工作会议上对于未来货币政策的表述，时隔 10 多年，货币政策取向从“稳健”再次改为“适度宽松”，将“保持流动性合理充裕”改为“保持流动性充裕”，体现出更为积极的宽松意图。

NCD 收益率在国庆节前后跟随债券市场有所调整，1 年期国股行 NCD 在节后冲高至 1.96% 后开启震荡下行，2 万亿再融资债于 11 月下旬发行过半，并未对资金面造成太大影响，NCD 收益率在 11 月底缓慢下行至 1.85%。11 月 28 日市场利率定价自律机制通过了《关于优化非银同业存款利率自律管理的自律倡议》，该倡议建议同业活期利率参考 OMO 利率，同时同业定期存款提支利率不得高于超额准备金利率，因同业活期利率下降，同业存款配置比例被动压降，市场对未来货币市场收益率下行预期加强，因此加大了对同业存单的配置力度，1 年期国股行 NCD 收益率快速震荡下行，年底前突破 1.6% 创下年内新低。截至年末时点 3 个月和 1 年期 AAA 评级 NCD 分别收于 1.595% 和 1.575%，较三季度末分别下行 28BP 和 34BP，长短端曲线倒挂。全年来看，3 个月和 1 年期 AAA 评级 NCD 收益率较年初分别大幅下行 71BP 和 87BP。

现券方面，国债收益率曲线从高位大幅下行，各期限品种在不同因素带动下均触及年内新低。债券市场对于基本面有所钝化，因此四季度的经济金融数据对债市影响有限，收益率的变化更多源自政策预期以及机构行为。国庆节后在风险偏好和刺激政策预期升温的影响下，长债收益率维持震荡，随着买断式逆回购工具落地，资金预期转松，同时稳增长各项政策逐步落地以及年内 2 万亿再融资债供给高峰过后，叠加风险偏好有所走弱，债市情绪重回乐观，利率又转而下行。10 年国债收益率在 12 月初破 2% 后，政治局会议对于货币政策表述的改变使得市场对于明年降准降息空间预期加强，也点燃了债市进一步做多热情，特别是市场抢跑年末年初配置行情，使得 10 年国债活跃券盘中最低触及 1.665% 的历史低点。12 月中下旬，有报道称央行约谈本轮债市行情中部分交易激进的金融机构，并针对债券市场违法违规行为进行处罚，长债收益率从低点有所反弹，但临近年末再次下行并收于年内低点。而 30 年国债一方面受到再融资债发行影响，另一方面也受制于大行持续卖出超长端地方债，30-10 的期限利差在四季度有所走阔。对于中短端品种，利好因素除上述提到的政策预期减弱、货币政策表述的改变以及市场利率定价自律机制对于同业活期的规范外，机构行为也带动短端品种快速下行。央行加大了国债买卖规模，同时商业银行出于年末各项指标的考虑，也加大了短久期国债和政金债的配置力度，带动中短久期品种收益率大幅下行，各期限均创出历史低点后在年末有所调整。截至年末，1 年、3 年、5 年、10 年、30 年国债收益率分别收于 1.08%、1.19%、1.42%、1.67% 和 1.91%，较季度初分别下行 28BP、38BP、42BP、48BP 和 44BP。全年来看，各期限较去年末分别大幅下行 100BP、110BP、98BP、88BP 和 91BP，整

体上曲线呈现陡峭化下行。

四季度，面对诸多扰动因素，组合灵活调整久期和杠杆水平，收益率走低后杠杆套息空间有限，优化组合持仓，并利用 10 年和 30 年活跃券积极开展波段交易。

12 月的政治局会议和中央经济工作会议发出明确讯号，将扩大内需列为 2025 年经济工作的重要着力点，将大力提振消费列为明年重点任务之首。在当前复杂多变的外部环境下，两次会议定调更加积极有为，明确提出“更加积极”财政政策与“适度宽松”货币政策，推出多项增量举措，释放出较大的政策想象空间。12 月 24 日财政工作会议指出，2025 年财政政策要“加大支出强度、加快支出进度”；25 日国务院办公厅发布《关于优化完善地方政府专项债券管理机制的意见》，有助于显著提升专项债使用效率。2025 年经济有望在政策的持续加力和靠前发力下延续回暖的势头，从而带动微观主体的信心进一步修复，微观主体的经济体感也有望明显改善。

对于债市而言，12 月的政治局会议以及中央经济工作会议对于维稳经济的定调较为积极，市场对于“超常规”的政策仍有期待，“强预期”到“强现实”的转变仍需要政策落地以及评估落地后的效果，对于基本面的复苏强度仍有待观察。逆周期调节过程中，财政的广义赤字率明年有望达到 10%，但财政政策面临约束较多，同时当前财政的乘数效应较 08 年、15 年也有所下降，集中化债、放松地方债发行条件有助于缓解地方政府现金流压力，后续仍需要带动地方政府投资积极性才可以更好地发挥稳增长作用。明年货币政策将更为积极，“适度宽松”的基调下，预计央行将加大降准降息幅度以及国债买卖的力度。有效需求不足的问题还有待解决，叠加化债背景下，资产荒也将延续，这在中长期将成为债券收益率继续突破前低的有效支撑。

短期来看，10 年国债创新低，5 年内利率债基本上均低于公开市场利率，反映出市场已经对降息进行了一定程度的定价。跨年后，面临税期和春节前取现需求激增，以及可能的政府债发行前置，降准有望更早落地。受开门红影响，年初的经济数据预计同比企稳，同时特朗普就职后对外政策如何落地也带有不确定性，在出口并未显著恶化的情况下，降息的迫切性有所减弱。因此在利率债收益率与资金中枢倒挂的情况下，短久期品种面临一定反弹压力，而年初止盈盘与配置盘博弈过程中也可能限制长债收益率进一步下行的空间。收益率低位，债市处于高胜率和低赔率的组合，降息落地前收益率上行空间不大，如果有调整则是比较好的配置机会。

组合将重点关注资金面及机构行为的变化，灵活调整久期和配置结构。短久期成分券收益率与资金倒挂，跨年后组合将视资金中枢变动灵活调整杠杆水平，久期选择上仍重点关注当前收益率水平上债市的赔率情况。同时密切关注风险偏好提升带来的理财赎回问题，以及地方债、政金债供给对市场造成的扰动，把握长债和超长债的波段机会。努力提高交易胜率以增厚组合收益，在控制回撤的基础上获取稳定收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数 A 份额净值增长率为 1.83%，业绩比较基准收益率为 0.78%。

本报告期内，景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数 C 份额净值增长率为 1.83%，业绩比较基准收益率为 0.78%。

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	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	9,278,354,990.94	97.51
	其中：债券	9,278,354,990.94	97.51
	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	2,499,854.19	0.03
8	其他资产	234,171,135.45	2.46
9	合计	9,515,025,980.58	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

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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	909,818,761.61	10.42
2	央行票据	—	—
3	金融债券	8,368,536,229.33	95.81
	其中：政策性金融债	8,368,536,229.33	95.81
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债(可交换债)	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	9,278,354,990.94	106.22

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	220305	22 进出 05	5,500,000	577,030,245.90	6.61
2	160310	16 进出 10	5,200,000	540,789,884.93	6.19
3	240403	24 农发 03	5,100,000	526,592,465.75	6.03
4	160213	16 国开 13	5,000,000	518,989,726.03	5.94
5	220402	22 农发 02	4,800,000	504,975,475.41	5.78

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金以提高对利率风险管理能力，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则参与国债期货投资。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析；构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、

国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

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

国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

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

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	234,171,135.45
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	234,171,135.45

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

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	景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数 A	景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数 C
报告期期初基金份额总额	7,213,093,412.63	61,120,620.47
报告期期间基金总申购份额	2,713,139,061.12	378,174,752.65
减：报告期期间基金总赎回份额	1,895,387,048.88	153,966,878.04
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	8,030,845,424.87	285,328,495.08

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§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中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金管理注册的文件；
- 2、《景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金管理合同》；
- 3、《景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金管理说明书》；

- 4、《景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数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

2025 年 1 月 22 日