

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 3 季度报告

2024 年 9 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：杭州银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 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 2024 年 10 月 24 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 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 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	7,274,214,033.10 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×95%+银行活期存款利率（税后）×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	7,213,093,412.63 份	61,120,620.47 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 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 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	73,409,659.35	370,613.77
2. 本期利润	48,443,918.25	40,159.08
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0080	0.0017
4. 期末基金资产净值	7,438,157,472.43	63,334,633.68
5. 期末基金份额净值	1.0312	1.0362

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

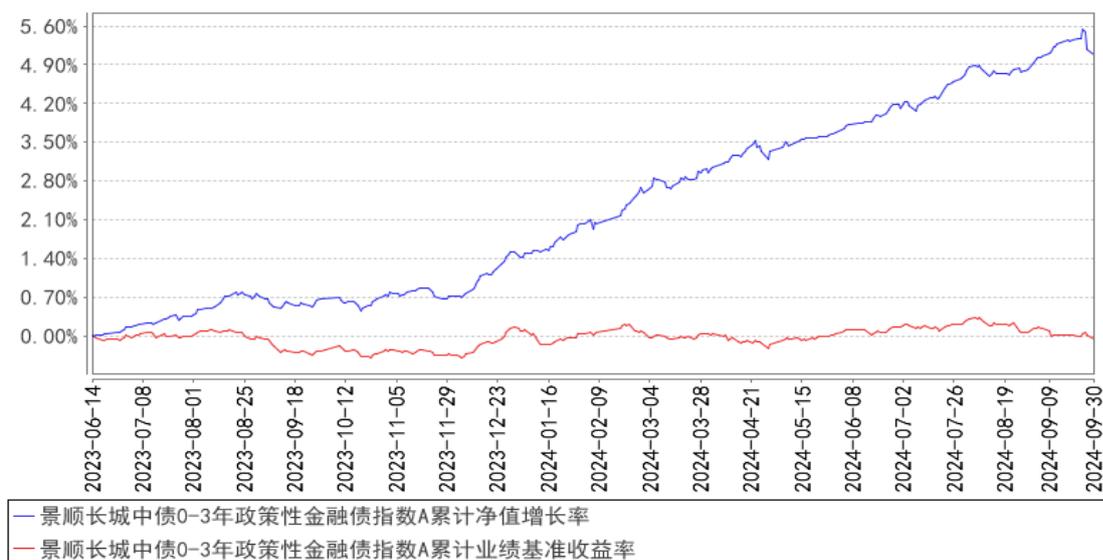
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.85%	0.07%	-0.23%	0.04%	1.08%	0.03%
过去六个月	2.01%	0.06%	-0.11%	0.03%	2.12%	0.03%
过去一年	4.39%	0.05%	0.22%	0.03%	4.17%	0.02%
自基金合同生效起至今	5.08%	0.05%	-0.06%	0.03%	5.14%	0.02%

景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数 C

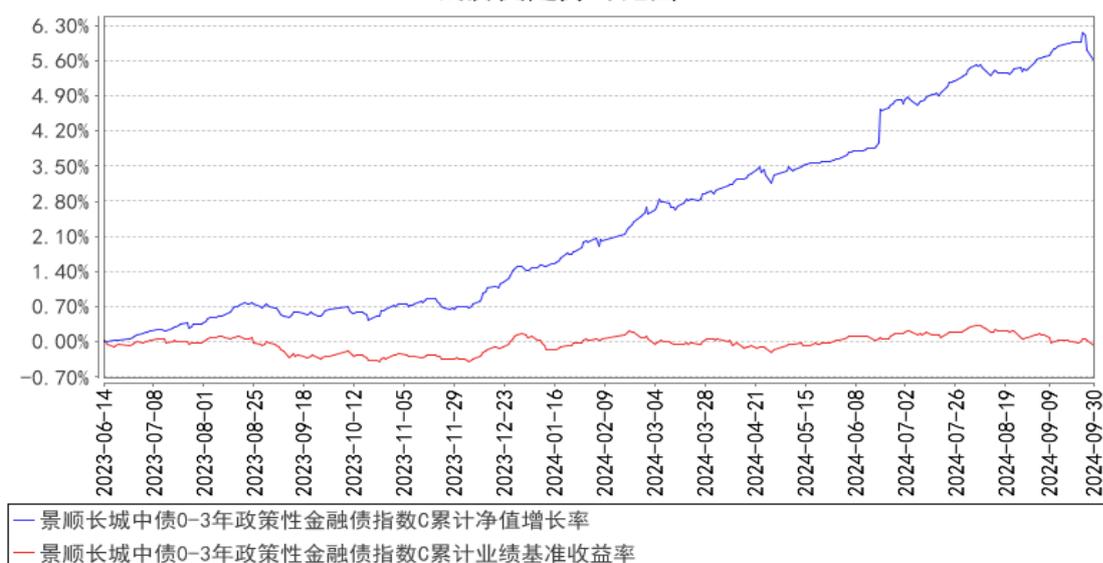
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.74%	0.07%	-0.23%	0.04%	0.97%	0.03%
过去六个月	2.53%	0.08%	-0.11%	0.03%	2.64%	0.05%
过去一年	4.91%	0.07%	0.22%	0.03%	4.69%	0.04%
自基金合同生效起至今	5.59%	0.06%	-0.06%	0.03%	5.65%	0.03%

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。报告期末距离建仓结束期未满一年。

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 14 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

三季度前两个月经济延续二季度继续下行，制造业 PMI 在三季度前两个月进一步走低，8 月回落至 49.1，9 月止跌回升至 49.8，连续 5 个月下行后企稳回升。虽然 7 月广义财政发力重回扩张区间，但财政资金的使用效率在下降，8 月广义财政支出再次下行，基建增速随之下行至 1.2%。8 月社会消费品零售总额同比增速从前值 2.7% 回落至 2.1%，季调环比增速再次负增长，环比下跌 0.01%，指向居民消费下行，与核心 CPI 环比增速节奏一致。8 月限额以上社零延续负增长，同比下跌了 0.6%，为非疫情扰动月份连续负增长。三季度以来消费者信心指数和就业预期指数继续下行，叠加收入增速下降，消费整体走弱。在“努力实现全年经济社会发展目标”的定调下，货币政策加大发力，“924”新政推出一系列货币金融政策组合拳，超市场预期，凸显政策层稳经济稳市场和提振微观主体信心的决心。“926”政治局会议罕见讨论经济议题，会议强调“加大财政货币政策逆周期调节力度”的同时，就地产、消费等领域做出了积极表态，地产层面出现“促进房地产市场止跌回稳”的新表述。本次会议对于提振经济预期和增强资本市场信心均具有积极的信号作用，后续需重点关注增量财政政策力度以及财政发力方向，财政最终的落地情况是经济基本面能否扎实企稳回升的关键。

三季度，央行货币政策保持积极，罕见的在一个季度内两次降息，在多种货币政策工具配合下资金面相对平稳，但资金中枢仍保持高位。7 月下旬，央行主动调降 OMO 政策利率 10BP，同时将逆回购操作调整为数量招标，从后续运行状况来看，公开市场基本上满足了金融机构的每日需求，在月末、税期以及政府债缴款较为集中的时点上，投放大量逆回购以平抑资金波动。因银行体系的长期限稳定资金仍相对稀缺，OMO 余额较高对银行间流动性预期造成一定扰动，波动加大，而资金价格也始终处于高位。从价格角度来看，DR007 月均值分别为 1.83%、1.79% 和 1.79%，资金中枢仍处于政策利率之上，与调降前未有明显下行。同时央行于 7 月初公告将视情况开展临时隔夜正逆回购操作，操作利率分别为 7 天期逆回购操作利率减点 20BP 和加点 50BP，这在一定程

度上也是对现有利率走廊的优化，因此三季度隔夜价格基本在 1.5%~2.2% 区间波动。9 月底国新办举行新闻发布会上，潘功胜行长预告了年底前的货币政策工具，同时政治局会议后，货币政策迅速落地，包括 9 月 27 日当天降准 50BP，MLF 利率和 OMO 利先后调降至 2.0% 和 1.5%，预计降存贷款利率以及存量房贷利率也在路上。

7 月份开始，为弱化 MLF 作为政策利率的色彩，央行将 MLF 操作调整到每月 25 日，在 LPR 公告之后。四季度 MLF 面临大量到期，央行也逐步将债券买卖作为基础货币投放的途径之一。从央行月末公告来看，三季度央行通过向部分公开市场业务一级交易商买入短期国债并卖出长期国债，全季净买入债券面值为 3000 亿元。

NCD 在 7 月份跟随 OMO 降息有所下行，8 月份受到理财赎回影响，收益率有所反弹，之后因资金中枢始终保持高位，1 年期国股行 NCD 基本围绕 1.95% 中枢震荡。季末前因 OMO 和 MLF 利率大幅下行，震荡中枢下行至 1.85% 附近，之后跟随债市调整有所反弹。至季末时点 3 个月和 1 年期 AAA 评级 NCD 收益率分别收于 1.87% 和 1.91%，较二季末分别变动 +7BP 和 -6BP，曲线有所走平。

现券方面，市场呈现结构性行情，长短端受多方面因素影响，定价逻辑有所分化，收益率整体上延续下行趋势，但在季末前触及历史低点后快速反弹。三季度，基本面数据仍在磨底，内需不足外需较强的特征没有改变，禁止手工补息和存款利率调降使得出表进程延续，从而加剧“资产荒”问题，整体对债市构成支撑。随着降息、降存贷款利率等政策落地，利率中枢的下行使得收益率曲线也处于下行通道中，但因央行从 4 月份开始关注并多次指导长债、超长债的过快下行，长端曲线受扰动较大，这一特点在三季度得以延续。7 月初央行公告面向部分公开市场业务一级交易商开展国债借入操作，带来长债的大幅上行。8 月 7 日交易商协会公告对涉嫌操纵市场价格、利益输送的四家机构启动自律调查，强监管带来债市收益率有所反弹，直至 8 月 21 日，交易商协会副秘书长徐忠针对“当前债市存在三个认识误区”发文，情绪稍微修复。但 8 月开始，大行在二级市场上卖出 7-10 年国债，债市始终受到牵制，利率债整体维持窄幅震荡，同时成交量从高位明显回落，债券流动性受到抑制，并带来信用债的调整，局部出现一定程度的负反馈，信用利差有所修复。9 月中上旬，市场逐步从 8 月信用债赎回的阴影中企稳，对大行卖债行为也有所钝化，同时受流动性转松、存量房贷利率下调预期渐浓、基本面数据仍偏弱等多重利好带动下，以及人大常委会并未调整当年赤字这一潜在利空的解除，整体收益率曲线呈现单边下行走势。24 日，国新办新闻发布会上潘行长提前预告了年内降准降息以及降低存量房贷利率等货币政策操作，随后政治局会议上对托底经济的定调积极，权益市场快速走强，债市走出利好出尽行情，且在风险偏好带动下收益率快速上行。

对于中短端曲线，定价逻辑除跟随长债外，本身还受到资金面和大行行为的影响，下行幅度

更大。随着央行将 OMO 操作改为数量招标，以及增加临时正逆回购工具，资金面确定性加强，短端相对收益。8 月份，大行在卖出长债的同时，也加大了 3 年内国债的买入力量，大行行为持续至 9 月中旬，从而带动 3 年内国债从高点下行超 30BP，并与资金利率倒挂。截至三季度末，1 年、3 年、5 年、10 年、30 年国债收益率分别收于 1.37%、1.56%、1.84%、2.15%和 2.36%，较季度初分别下行 20BP、27BP、18BP、10BP 和 12BP，整体上曲线呈现陡峭化下行。

三季度，组合整体维持中性偏长的久期，结合申赎情况，灵活配置 3 年内成分券。期间利用 10 年和 30 年活跃券调整组合久期，开展波段交易，适当增厚收益并控制回撤。因资金价格始终处于高位，杠杆套息效果一般，组合整体维持中性偏低的杠杆水平。

9 月末的政治局会议对于维稳经济的定调较为积极，从已经出台的政策来看，仍然是货币先行，降准降息均已落地，年内存量房贷利率和 LPR 下调基本也已确定，并且按照政治局会议上提出的“实施有力度的降息”，不排除四季度仍存在降准降息的可能。国庆长假前，四个一线城市均公告了对于限购政策的优化，广州更是全面放开限购，对于房地产市场能否“止跌回稳”，还需要观察地产销售数据以及政策放松后效果的持续性。而对于经济能否企稳，也还需要观察配套政策的落地，特别是财政政策是否会加大力度。财政政策确认仍需要等待 10 月份人大会议，在此之前，风险偏好对债市始终有压制。即使配套政策超预期，地产投资、消费的企稳仍较为漫长，企业盈利修复也可能要等到明年才可以看到，但货币政策确定性较高，因此债市也不具备反转的基础。

经历三季末收益率大幅反弹后，债市已经进入配置区间，无论从降息后的债券定价、贷款债券比价效应、期限利差或是未来货币政策空间的角度来看，长债、超长债继续上行的空间有限，当前已经出现较高赔率。降准降息落地后，资金面宽松是大概率事件，同时资金中枢也将跟随 OMO 利率调降而下降，中短端确定性更大。短期需要重点关注股市赚钱效应带来的理财赎回问题，可能会放大市场波动，但对于长债也增加了波段交易的机会。关注权益市场上涨动能减弱后长端的交易机会，以及大行可能的买入长债带来的收益率见顶信号。

组合将重点关注基本面及机构行为的变化，灵活调整久期和配置结构。跨季后视镜资金中枢情况可以增加杠杆水平，配置上重点关注中短端错杀品种。同时密切关注股市赚钱效应带来的理财赎回问题，以及财政政策落地后可能的政府债供给冲击，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

2024 年 3 季度，景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数 A 类份额净值增长率为 0.85%，业绩比较基准收益率为-0.23%。

2024 年 3 季度，景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数 C 类份额净值增长率为 0.74%，业绩比较基准收益率为-0.23%。

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	8,490,321,310.27	99.93
	其中：债券	8,490,321,310.27	99.93
	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	3,807,530.14	0.04
8	其他资产	2,261,856.53	0.03
9	合计	8,496,390,696.94	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	522,369,483.70	6.96

2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,967,951,826.57	106.22
	其中：政策性金融债	7,967,951,826.57	106.22
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	8,490,321,310.27	113.18

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	569,406,885.25	7.59
2	220315	22 进出 15	5,100,000	526,773,690.41	7.02
3	160310	16 进出 10	5,000,000	514,132,602.74	6.85
4	160213	16 国开 13	5,000,000	512,945,890.41	6.84
5	220402	22 农发 02	4,800,000	497,733,508.20	6.64

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

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计 (元)					-
国债期货投资本期收益 (元)					2,295,726.00
国债期货投资本期公允价值变动 (元)					-

注：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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在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	2,261,856.53
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,261,856.53

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	5,860,059,998.08	3,274,568.19
报告期期间基金总申购份额	3,097,907,592.70	124,117,598.95
减：报告期期间基金总赎回份额	1,744,874,178.15	66,271,546.67
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	7,213,093,412.63	61,120,620.47

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募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金招募说明书》；
- 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

2024 年 10 月 25 日