

景顺长城 30 天滚动持有短债债券型证券投资
基金
2025 年第 1 季度报告

2025 年 3 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 4 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 4 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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城 30 天滚动持有短债债券
基金主代码	013492
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 4 月 27 日
报告期末基金份额总额	2,699,308,674.04 份
投资目标	本基金主要通过投资于固定收益品种，在严格控制风险的基础上，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>本基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况进行调整，资产配置组合主要以债券等固定收益类资产配置为主，并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例，使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上优化投资组合。</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、信用债投资策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</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。</p>

	<p>4、国债期货投资策略 本基金可基于谨慎原则，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。</p> <p>5、信用衍生品投资策略 本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。</p>	
业绩比较基准	中债综合财富(1年以下)指数收益率*90%+银行一年期定期存款利率(税后)*10%	
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	景顺长城 30 天滚动持有短债债券 A	景顺长城 30 天滚动持有短债债券 C
下属分级基金的交易代码	013492	013493
报告期末下属分级基金的份额总额	881,947,562.78 份	1,817,361,111.26 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(2025年1月1日-2025年3月31日)	
	景顺长城 30 天滚动持有短债债券 A	景顺长城 30 天滚动持有短债债券 C
1. 本期已实现收益	4,822,530.48	10,252,863.40
2. 本期利润	3,441,028.26	6,491,228.16
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0037	0.0029
4. 期末基金资产净值	957,688,655.73	1,960,475,433.38
5. 期末基金份额净值	1.0858	1.0787

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 30 天滚动持有短债债券 A

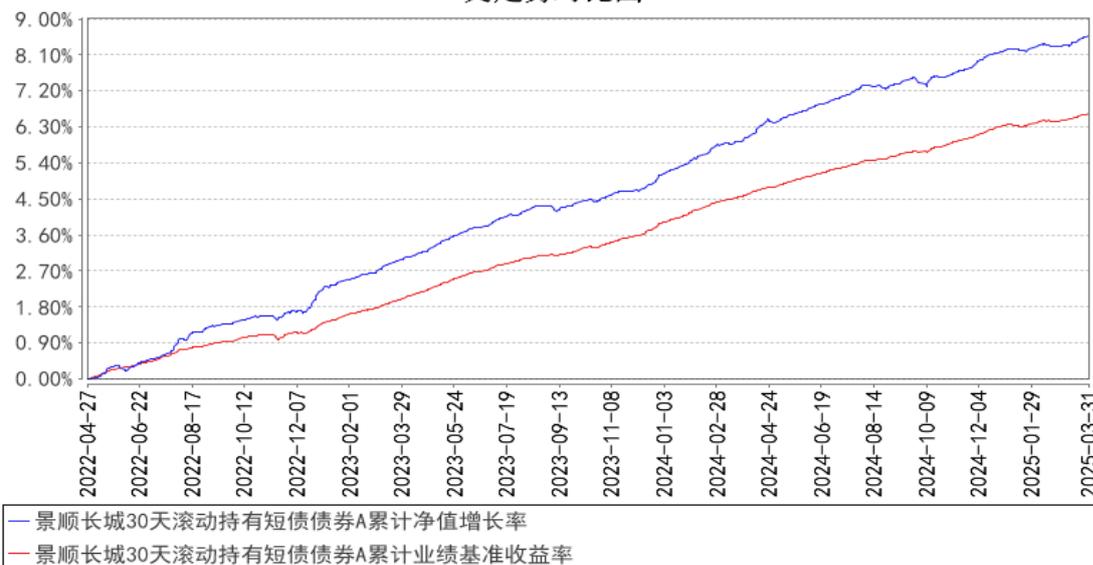
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.35%	0.02%	0.28%	0.01%	0.07%	0.01%
过去六个月	1.09%	0.02%	0.92%	0.01%	0.17%	0.01%
过去一年	2.40%	0.02%	1.95%	0.01%	0.45%	0.01%
自基金合同生效起至今	8.58%	0.02%	6.64%	0.01%	1.94%	0.01%

景顺长城 30 天滚动持有短债债券 C

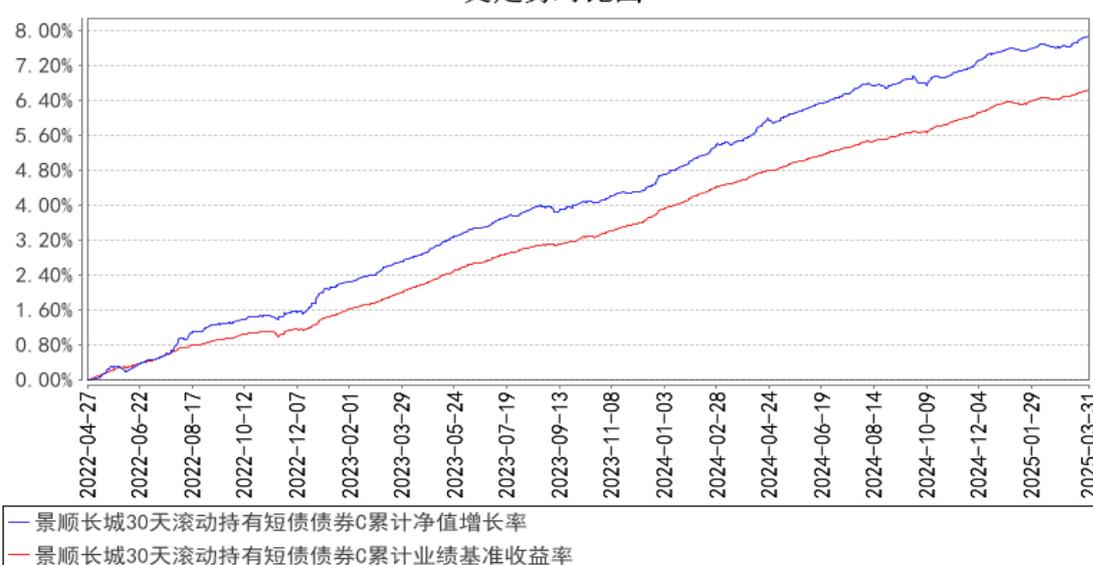
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.31%	0.02%	0.28%	0.01%	0.03%	0.01%
过去六个月	0.99%	0.02%	0.92%	0.01%	0.07%	0.01%
过去一年	2.21%	0.02%	1.95%	0.01%	0.26%	0.01%
自基金合同生效起至今	7.87%	0.02%	6.64%	0.01%	1.23%	0.01%

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30天滚动持有短债债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城30天滚动持有短债债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的 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，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的建仓期为自 2022 年 4 月 27 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	2022 年 4 月 27 日	-	11 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 11 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 30 天滚动持有短债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

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

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未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2025 年一季度总体的宏观经济走势延续去年四季度以来温和回升的态势，DeepSeek 等中国科技突破大幅增强了市场信心，财政前置发力有效对冲外部冲击的不确定性。2025 年 1-2 月，我国经济生产端总体平稳增长，新质生产力行业改善较多。1-2 月工业增加值、服务业生产指数同比分别为 5.9%、5.6%，生产端的良好开局为一季度经济增长实现开门红奠定了坚实基础。1-2 月固定资产投资同比增长 4.1%，较去年 12 月上升 1.9 个百分点，房地产、基建和制造业投资同比较 12 月均有上升。消费受春节和“以旧换新”政策的持续支撑，1-2 月社零总额同比增长 4%，较去年 12 月增速提高 0.3 个百分点，分项上通讯器材、家具、文化办公用品等“以旧换新”相关品类消费增长较快。房地产方面，热点城市带动拿地回暖，竣工提振投资，但开工仍旧较弱，四季度止跌回稳组合拳带来的销售脉冲正逐步减弱。1-2 月全国商品房销售面积同比转负至-5.1%，销售金额同比转负至-2.6%。虽然今年以来二手房成交保持较为火热的态势，但是价格仍有下行的压力，其中一线城市二手房价格在连续四个月环比正增长之后 2 月重新转为环比下跌，二三线城市的一二手房价依旧处于环比下跌的趋势。财政发力带动了金融数据短期向好，1 月信贷数据开门红后，2 月金融数据则反映政府和非政府相关经济活动仍有分化，信贷需求处于复苏早期。价格水平距离全年物价目标仍有较大距离，指向有效需求仍待进一步提振。根据两会财政预算报告测算，全年 GDP 平减指数的目标为-0.11%，比去年降幅收窄 0.6 个百分点左右。但今年以来价格下行压力边际有所加大，反映供需缺口仍在。

海外方面，美联储 3 月 FOMC 会议维持政策利率在 4.25%-4.5% 不变，但大幅放缓缩表速度，从 4 月 1 日起将持有美国国债的缩减节奏由 250 亿美元/月大幅放缓至 50 亿美元/月，MBS 缩减节奏则保持不变。此外，3 月 FOMC 声明中增加了“经济前景不确定性上行”的同时删除了“实现其就业和通胀目标的风险大致平衡”，指向联储更担忧经济下行而非通胀上行风险。通胀前景方面，鲍威尔认可关税对商品通胀的影响，但淡化通胀预期的上行，且认为关税通胀是暂时性的。增长前景方面，认为经济基本面尚可，但对增长下行风险的担忧上升。联储官员将 2025 年美国经济增长预期从 2.1% 下调至 1.7%，PCE 预期从 2.5% 上调至 2.7%，指向美国“滞胀”的风险在边际提升。美国 2 月份的通胀数据回落幅度超市场预期，核心 CPI 同比从前值 3.3% 降至 3.1%，短期内通胀风险有所缓解，但是从中期维度，通胀风险仍受到关税政策不确定性的扰动，长期的通胀预期也有进一步上行的风险。当前就业等“硬数据”依然保持稳健，三个月平均新增非农就业保持在 20 万左右，失业率也维持在 4.1% 的低位，居民和企业的资产负债表依旧健康，但是家庭和企业调查

的“软数据”已经有明显走弱，消费者信心指数和 NFIB 中小企业信心指数大幅下行，“软数据”有进一步向“硬数据”传导的风险。后续需重点关注 4 月份关税政策的落地情况，以及减税法案和债务上限法案的推进情况。

一季度，最大的预期差来自于央行货币政策，在稳汇率、防风险、防空转的基调下，流动性明显收敛，资金价格保持高位。去年 12 月政治局会议上货币政策重提“适度宽松”，市场对于今年央行降准降息预期较高，但在一季度银行面临较大的流动性压力情况下，资金面明显转紧。从对冲手段来看，央行也相对克制，表现为当季并未进行降准降息操作，同时在公开市场操作方面也仅仅通过 OMO 提供短期流动性，比如春节前大额投放约 2.6 万亿，季末前也只投放了约 1.3 万亿跨季资金。3 月 24 日尾盘，央行公告 MLF 之后将采用固定数量、利率招标、多重价位中标方式开展操作，MLF 政策利率属性进一步淡化，3 月的 MLF 也时隔 7 个月再次净投放，但从季度来看 MLF 余额仍继续下滑，当季共计回笼 9320 亿。在买断式回购操作方面，央行在前三个月分别净投放 1.7 万亿、0.6 万亿以及 0.1 万亿，投放力度也逐步减弱。1 月初，央行公告暂停开展公开市场国债买入操作，截至季末仍未恢复购买。

受到 11 月非银同业存款利率自律影响，非银存款大幅下降超 4 万亿，大行负债压力在年初明显增大，特别是临近春节，受 MLF 到期、春节取现需求增加以及税期影响，资金中枢大幅提升，个别时点隔夜资金价格成交在 10%以上。2、3 月份，月中在税期走款和 MLF 到期错位时资金面有所收敛，月末、季末逐步转为均衡，虽然并未重现极端情形，但隔夜价格中枢始终维持在 1.8%以上。DR007 月均值分别为 1.93%、2.01%和 1.88%，均大幅高于政策利率。

央行的操作以及资金价格高位运行，叠加央行在不同场合的多次表态，市场对于“适度宽松”的货币政策预期逐步消退，债市对此反应剧烈，收益率曲线从年初低位大幅调整，中短端调整更大。以同业存单为例，春节前大行积极提价通过主动负债弥补较大的负债缺口，而流动性异常收紧，非银卖出负 carry 资产主动去杠杆，NCD 供需矛盾集中体现，3M、1Y 国股行 NCD 收益率从年初低点 1.54%、1.58%分别快速反弹至 1.98%和 1.75%，曲线倒挂。虽然春节后资金面稍有缓和，带动收益率曲线高位回落，但随着资金中枢始终维持在 1.8%之上，货币政策宽松预期退坡，银行负债问题也未得到缓解，NCD 对资金价格重定价，3M 国股行 NCD 继续大幅上行至 2.12%，而 1Y NCD 也跟随调整，在 3 月中旬上行至 2.03%，为本轮调整的高点。之后随着银行融出逐步回升，标志着负债问题得到一定程度的解决，同时非银季末前加大配置力度，收益率从高位回落，曲线也不再倒挂，但仍极度平坦。截至一季末，3M 和 1Y AAA 评级 NCD 分别收于 1.865%和 1.885%，较去年末分别上行 31BP 和 27BP，曲线熊平。

现券方面，中短端利率债跟随 NCD 的调整，也在一季度大幅上行，特别是短久期国债，去年

四季度因央行买债收益率大幅下行，本轮调整过程中也受伤最重，1 年期和 3 年期国债从年初低点 1.02%、1.12% 均上行 57BP。长债和超长债虽然受到央行暂停国债买卖和窗口指导等调控措施影响从低点有所回调，但在基本面预期并未明显改善、年初欠配压力较大以及博弈资本利得的作用下，仍具有较强韧性，特别是 30 年国债活跃券，在春节后触及 1.8% 反而创出年内新低。但随着 Deepseek 的重大突破和民企座谈会提振投资者信心，人工智能、机器人等科技股快速上涨带动风险偏好显著回升，长债开始承压并跟随补跌。3 月初两会召开，并未有太多超预期政策落地，同时 3 月公布的经济金融数据也未对债市产生太大扰动，但央行的表态令市场持续修正宽松预期，造成收益率继续上行，另外银行自营为调节季报卖出 OCI 账户浮盈债券也让债市更为承压。10 年、30 年国债活跃券在 3 月中最高上行至 1.9% 和 2.14%，季末前有迹象表明央行对资金管控有所放松，收益率略有下行。截至一季末，1 年、3 年、5 年、10 年、30 年国债收益率分别收于 1.54%、1.61%、1.65%、1.81% 和 2.02%，较去年末初分别上行 46BP、19BP、23BP、14BP 和 11BP。

一季度，在收益率调整过程中，组合维持偏低的久期和较低的杠杆水平，在局部负反馈结束后，组合逐步拉长久期。因收益率曲线极度平坦，配置上以绝对票息较好的 1 年内信用债和高等级 NCD 为主，同时通过银行二永债等交易品种小仓位开展波段操作，并结合国债期货进行对冲以控制组合回撤。虽然资金价格较高，但信用债调整后仍具有较好的套息空间，因此组合季末前维持中性偏高的杠杆水平。

过往几年在一季度开门红后，政策发力减弱使得市场对经济复苏的节奏有所修正，债市在二季度有望回归基本面定价逻辑。近期的宏观高频数据也呈现出震荡的走势，环比动能有所减弱。后续中美关税协议落地仍有较大不确定性，但预计抢出口脉冲将逐步衰退，同时票据利率显示未来的信贷需求有可能季节性走弱，基本面对债市没有明显利空，收益率上行风险可控。

流动性层面，从近期央行操作方式来看态度边际缓和，即使跨季后 OMO 回笼，预计冲击有限，后续重点关注隔夜资金中枢是否下行。虽然市场对于货币政策宽松预期降温，但央行多场合强调“择机降准降息”，后续面临海外风险事件冲击，政府债供给压力加大，四月份降准落地概率较大。另外，去年 11 月存款自律对银行同业负债造成较大缺口，而一季度银行通过主动负债方式将非银存款以同业存单和存款形式回流到银行体系，随着银行负债压力的减轻以及 MLF 招标方式的改革，预计 1 年期国股行 NCD 收益率上行空间有限，同时若资金中枢回落，NCD 曲线有望修复，呈现陡峭化下行走势。

对于现券市场，目前的收益率曲线依然偏平坦，短端主要还是受制于资金利率偏高，但预计当前资金价格只是暂时性的，跨季后有望回归正常水平。目前中短端品种相对价值突出，且并未对降息有过多定价，特别是仍有套息空间且具有较好骑乘收益的中段品种，配置需求回归后也有

望进一步修复。以 10 年国债为代表的长债本轮经过 30BP 的上行后，再次下行至 1.8% 附近，赔率有所降低，在市场分歧加大后，也会放大收益率波动，对于长债、超长债依然维持震荡走势的判断，宜采取波段交易策略。

当前信用债收益率具有一定套息空间，跨年后理财规模季节性增长也会带来一定的配置需求，可以结合利差水平配置中短久期信用债。但当前信用利差有所压缩，曲线也极度平坦，久期暴露仍需要谨慎择时，组合将关注后续资金面和信用利差的变化情况，灵活调整杠杆水平，并择机降低组合中商金债、二永债的风险暴露，避免净值的大幅波动，同时把握长久期利率债和地方债的波段机会，控制回撤的同时增厚收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 0.35%，业绩比较基准收益率为 0.28%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 0.31%，业绩比较基准收益率为 0.28%。

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	3,698,289,134.14	98.67
	其中：债券	3,698,289,134.14	98.67
	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	41,218,879.15	1.10
8	其他资产	8,763,102.25	0.23
9	合计	3,748,271,115.54	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	732,463,647.13	25.10
	其中：政策性金融债	174,042,189.04	5.96
4	企业债券	658,655,950.71	22.57
5	企业短期融资券	1,305,260,720.67	44.73
6	中期票据	517,040,671.23	17.72
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	447,732,322.97	15.34
9	其他	37,135,821.43	1.27
10	合计	3,698,289,134.14	126.73

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	2028052	20 恒丰银行永续债	1,230,000	127,315,716.16	4.36
2	072410104	24 中信建投 CP002	1,000,000	101,444,367.12	3.48
3	240543	24 中证 S2	1,000,000	100,720,394.52	3.45
4	012483896	24 株洲城建 SCP002	1,000,000	100,537,726.03	3.45
5	072510053	25 中信建投 CP001	1,000,000	100,021,150.68	3.43

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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
TF2506	TF2506	30	31,684,500.00	72,000.00	根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以以套期保值为目的，适度参与国债期货投资。本报告期间，我们同时持有多空期货合约，久期中性。
TF2506	TF2506	-30	-31,684,500.00	-94,500.00	根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以以套期保值为目的，适度参与国债期货投资。本报告期间，我们同时持有多空期货合约，久期中性。
公允价值变动总额合计（元）					-22,500.00
国债期货投资本期收益（元）					803,040.42
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-38,500.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金可基于谨慎原则，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过

多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

5.10 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

恒丰银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证监会的处罚。

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	413,560.51
2	应收证券清算款	48,991.31
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,300,550.43
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,763,102.25

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 30 天滚动持有	景顺长城 30 天滚动持有短
----	---------------	----------------

	短债债券 A	债债券 C
报告期期初基金份额总额	956,570,321.71	2,746,407,962.09
报告期期间基金总申购份额	64,792,124.91	612,042,684.23
减:报告期期间基金总赎回份额	139,414,883.84	1,541,089,535.06
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	881,947,562.78	1,817,361,111.26

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

基金管理人本期末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 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城 30 天滚动持有短债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

2025 年 4 月 22 日