景顺长城30天滚动持有短债债券型证券投资基金
2026年第3季度报告

2026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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2026年10月27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约定，于 2026 年 10 月 26 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 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 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	2,709,017,732.68 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	1、资产配置策略 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。 2、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。 3、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。

	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。 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。	
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	1,136,356,776.58 份	1,572,660,956.10 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（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 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	6,283,502.52	7,432,482.85
2.本期利润	5,496,674.47	6,409,526.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.0047	0.0041
4.期末基金资产净值	1,269,701,429.25	1,740,423,272.63
5.期末基金份额净值	1.1173	1.1066

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

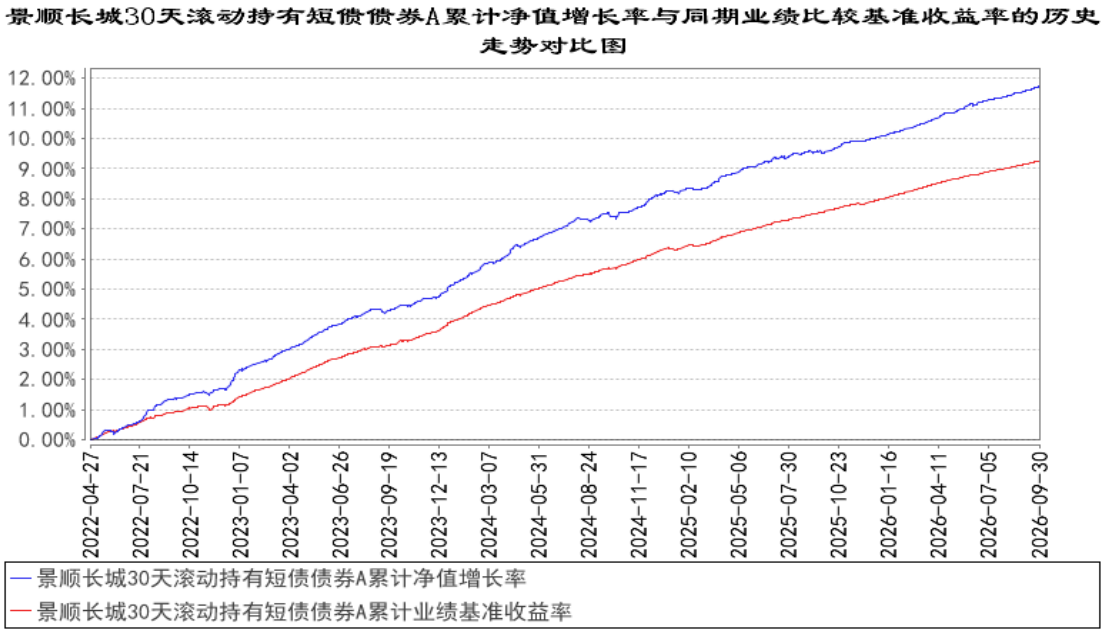
景顺长城 30 天滚动持有短债债券 A

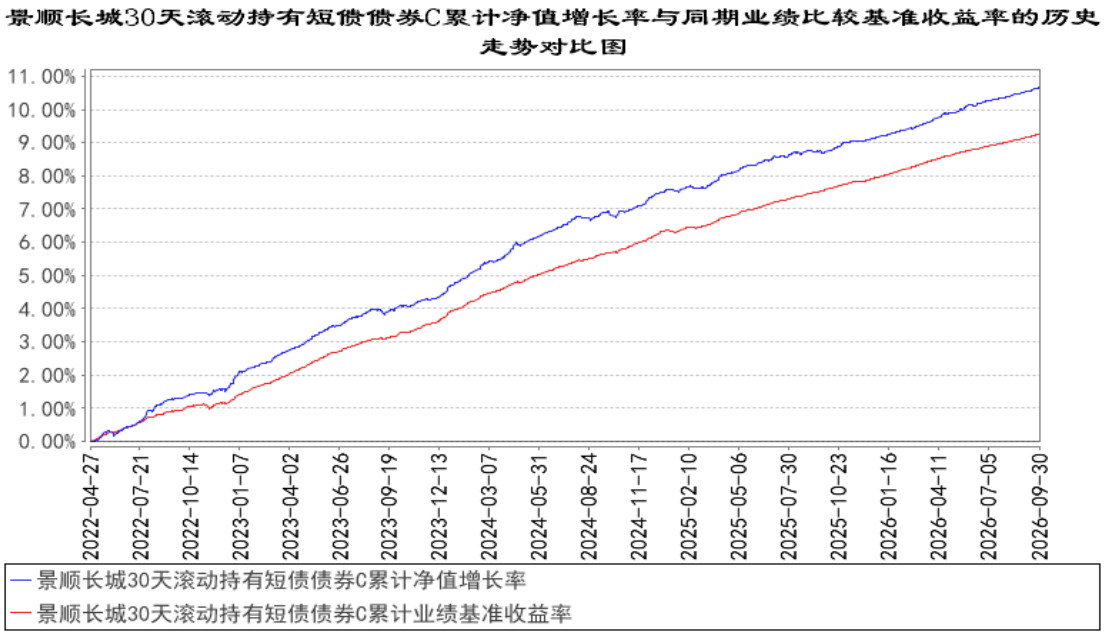
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.42%	0.01%	0.35%	0.00%	0.07%	0.01%
过去六个月	1.01%	0.01%	0.74%	0.01%	0.27%	0.00%
过去一年	1.99%	0.01%	1.57%	0.01%	0.42%	0.00%
过去三年	7.04%	0.02%	5.90%	0.01%	1.14%	0.01%
自基金合同生效起至今	11.73%	0.02%	9.26%	0.01%	2.47%	0.01%

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	0.37%	0.01%	0.35%	0.00%	0.02%	0.01%
过去六个月	0.91%	0.01%	0.74%	0.01%	0.17%	0.00%
过去一年	1.78%	0.01%	1.57%	0.01%	0.21%	0.00%
过去三年	6.39%	0.02%	5.90%	0.01%	0.49%	0.01%
自基金合同生效起至今	10.66%	0.02%	9.26%	0.01%	1.40%	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





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	-	12 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 12 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。

4.1.1 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 1 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

经过了二季度内需快速下滑之后，730 政治局会议要求加大逆周期调节力度和加快存量政策落地，从三季度前两月数据表现来看，财政落地节奏依旧较慢，内需延续较弱状态，生产在出口强劲和新兴产业带动下有所回升。从 8 月最新的经济数据来看，社零增速从前值 0.6%回落至 0.4%，三季度以来持续走低，与消费的较弱表现相互印证。投资跌幅小幅收窄，但依旧保持着同比双位数以上的下滑，投资表现的持续较弱与企业中长贷持续负增也相互印证。房地产市场继续延续分化格局，一线城市二手房价已经实现连续 6 个月环比正增长，二三线城市二手房依旧环比下滑。出口（美元计价）同比增速由前值 24%略微回升至 25%，继续超出市场预期，AI 产业高景气度、关税扰动消退下美国补库、中国供应链竞争力凸显依旧是出口强劲表现的核心动力。受国际油价上涨、食品价格季节性上涨等因素影响，CPI 环比由上月下降 0.1%转为上涨 0.4%，PPI 环比由上月下降 0.7%转为上涨 0.4%，其中能源价格上涨和 AI 链条产品价格上涨依旧是 PPI 涨价的核心驱动力。

三季度，央行延续支持性的货币政策，通过灵活使用多种货币政策工具，促进流动性保持宽松，资金面平稳。与二季度持续回笼中长期流动性形成鲜明对照，三季度央行全面恢复中长期流动性净投放。当季买断式逆回购累计净投放 9000 亿，MLF 累计净投放 2000 亿，带动 9 月末 MLF 余额增至 7.6 万亿元。三季度最大看点是 6 月新设的隔夜逆回购工具首次在月中税期操作，因此从操作次数上来看，从 6 月到 9 月，隔夜逆回购分别操作了 2 次、3 次、8 次和 8 次，单日上限也从最初的 3000 亿提高至 9 月底的 1 万亿，使用频率和规模的增加也为该工具进一步常态化奠定了基础。

三季度资金面稳中偏松，DR001 季度均值约 1.38%，DR007 约 1.41%，围绕政策利率 1.4%平稳运行。从波动率来看，2026 年连续三个季度 DR007 的标准差不足 6bp，特别是三季度只有 2.8bp，而央行精细化管理的成效在季末尤为突出：9 月 23~30 日 DR001 极差仅 3bp，相较 2025 年同期的 16bp 明显下降。说明在新的货币政策框架下，央行通过引入隔夜逆回购工具，更好地控制了资金波动，流动性更为平稳。三季度大行融出整体回落，但中小行、货基融出回升，非银与银行分层几乎消失，加之非银杠杆处于近年低位，大行融出回落并未引发资金价格大幅上行。

受益于资金价格波动降低，三季度 NCD 市场运行也相对平稳，各期限收益率均窄幅波动。其中 1 年期国股行 NCD 整体处于 1.45%-1.50%的区间窄幅震荡，8 月底和 9 月中旬受资金价格上行和

银行补充长期负债影响，收益率上行至 1.495%的季度内高位，但始终未突破机构预期的 1.5%的上限，最终收于 1.47%。3 个月和 6 个月品种从二季度末低点跟随资金中枢有所抬升后，随着跨季价格转松后重回下行。1Y-3M 的期限利差跟随 3 个月品种先压缩再走阔，而受跨年因素影响，1Y-6M 的利差始终处于 2-3bp 的偏低水平。

三季度债券收益率震荡下行，曲线牛平，虽然同期中美 10 年期国债利差倒挂超 350bp，中债受益于基本面偏弱、通胀温和与货币宽松走出独立行情。7 月初，基金负债端受季节性赎回扰动，跨季后资金转松较慢、央行买债缩量，利率上行；随后买断式逆回购放量、经济数据边际走弱，货币政策打开想象空间，叠加偏弱 PMI 催化，长债持续走强。8 月中上旬，资金宽松、中小公募摊余债基开启发行潮、经济金融数据偏弱、宽货币预期略升温，推动利率进一步下行；下旬，受到央行调研传闻和股市回暖影响，利率小幅上行。进入 9 月，上旬市场担心供给压力、债市季节性魔咒和增量政策预期，利率阶段性承压；9 月中下旬，前期担忧的利空逐步落空，叠加央行呵护跨季流动性，利率再度下行，超长表现更强。季度内，曲线持续平坦化，30-10 国债期限利差在 9 月底压缩至 41bp 的年内低点。而中短端政金债品种得益于资金面的稳定和杠铃策略带来的配置力量，三季度保持下行趋势，并收于年内低点。

三季度，组合延续杠铃策略，以短久期商金、银行永续债为底仓，增加了交易仓位占比，因此组合久期波动范围较大，同时根据信用利差、期限利差和品种利差灵活调整持仓结构，并结合机构行为做好品种轮动。组合杠杆维持中性水平，季末前略有下降。超长债、银行二永债等交易品种在下行过程中波动加大，组合也适时通过国债期货对冲，有效平滑了组合净值。

展望未来，随着 9 月政策性金融工具的逐步落地对投资端的支撑，专项债等其他财政工具在四季度加速投放落地，以及“929”落地的 PSL 降息提额和地产贴息政策有望带来一定融资需求的提升，叠加低基数，预计四季度经济或将有所回暖。出口韧性大概率持续，但需要关注持续扩大的顺差也将带来贸易摩擦的加剧。消费仍受居民就业和预期偏弱制约，828 房地产新政或有助于加速房地产价格止跌回稳，但对土地出让和房地产投资或有所冲击。价格方面，油价的波动是 PPI 的核心影响因素，鉴于二季度的工业产能利用率已降至历史最低水平附近，剔除油价的外生影响，PPI 内生上行动能并不强。

央行在三季度货币政策例会中进一步聚焦“加大逆周期调节力度”，相较二季度例会，删去了“跨周期”表述，未来政策重心重新回归稳增长对冲。9 月底国常会部署了下一步工作安排后，央行调整完善了多项结构性货币政策工具，因此短期来看，总量降息政策出台的概率有所降低。后续政策发力点仍将维持流动性宽松，资金价格稳定，而且有可能通过扩大国债买卖额度来配合可能的四季度 “用好地方政府债务结存限额”带来的政府债供给增加。

展望四季度，我们对债市仍维持乐观判断，因收益率处于年内低点位置，且降息预期降低后，走势不会一帆风顺，但利差压缩的空间仍存在。稳增长的急迫性有所提高，但存量提速和结构性支持的政策意味着总量层面宽信用出现的概率不高。9 月底落地的增量政策能否带来融资需求提升仍有待观察，基本面预计延续外需强、内需弱格局，对债市而言调整风险相对有限。结构性降息有利于改善银行负债端成本，打开广谱利率下行空间，若可以传导至 LPR 下调，则可以通过债券贷款的比价效应向债市传导。虽然四季度政府债券总体仍有供给压力，但结构上超长债供给高峰已过，叠加 2027 年置换债额度归零也将带来债券发行加权久期的下降。短期我们仍需要关注政策性金融工具的落地效果以及是否有其他增量措施，当前债市赔率降低后，短期可能再次进入一种低波状态，消化之前的浮盈筹码，并等待新增的交易热点，重聚多头信心。中短端品种围绕资金中枢定价，基本维持上有顶、下有底状态，无降息则难有大幅下行空间，宜作底仓获取票息与骑乘收益。10 年国债在央行宏观审慎框架下，政策利率不调降的情况下也很难突破 1.65%。超长债目前为赔率相对优品种，虽然期限利差有所压降，但仍处于历史偏高水平，且随着供需结构改善，不排除四季度有配置资金抢跑入场。

当前信用利差维持低位，组合将重点关注资金中枢的变化以及理财、固收+等机构行为对市场的扰动，关注摊余成本法债基成立后对 5 年信用债的配置需求，可以积极参与长久期信用债波段交易，严格交易纪律，做好止盈止损。1 年内普信债利差维持低位，仅作为底仓来配置，优选票息品种，虽然不具备大跌的基础，但是赔率也较低，如果有调整可以适当增加杠杆仓位。在低利率环境下，关注组合持仓的流动性，力争在市场转向过程中可以及时降低风险敞口，更好地利用国债期货对冲控制回撤。

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 0.42%，业绩比较基准收益率为 0.35%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 0.37%，业绩比较基准收益率为 0.35%。

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	3,429,250,916.11	94.53
	其中：债券	3,429,250,916.11	94.53
	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	135,015,444.12	3.72
	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	37,782,456.83	1.04
8	其他资产	25,561,617.27	0.70
9	合计	3,627,610,434.33	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	27,050,234.84	0.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,877,789,217.55	62.38
	其中：政策性金融债	358,490,465.76	11.91
4	企业债券	882,348,955.10	29.31
5	企业短期融资券	252,150,668.50	8.38
6	中期票据	142,296,042.74	4.73
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	247,615,797.38	8.23
9	其他	-	-
10	合计	3,429,250,916.11	113.92

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	2128047	21 招商银行永续	1,700,000	175,797,214.25	5.84

		债			
2	2120089	21 北京银行永续债 01	1,600,000	166,845,413.70	5.54
3	072610027	26 国信证券 CP002	1,500,000	151,716,131.51	5.04
4	2228001	22 邮储银行永续债 01	1,200,000	123,613,670.14	4.11
5	2420021	24 南京银行 01	1,200,000	121,528,221.37	4.04

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
TL2612	TL2612	-20	-23,372,000.00	36,952.38	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，我们选择持有一定比例的国债期货空头，以部分对冲超长债券持仓，控

					制组合净值波动。
公允价值变动总额合计（元）					36,952.38
国债期货投资本期收益（元）					-302,585.89
国债期货投资本期公允价值变动（元）					36,952.38

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

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局处罚。

北京银行股份有限公司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监管局、中国人民银行处罚。

中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、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。

5.10.2 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	860,581.84
2	应收证券清算款	20,531,164.65
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,169,870.78
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	25,561,617.27

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 天滚动持有短债债券 A	景顺长城 30 天滚动持有短债债券 C
报告期期初基金份额总额	1,199,343,606.82	1,571,789,932.48
报告期期间基金总申购份额	56,183,634.39	205,554,360.81
减：报告期期间基金总赎回份额	119,170,464.63	204,683,337.19
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	1,136,356,776.58	1,572,660,956.10

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）

机构	1	20260701-20260722	571,983,437.29	-	72,174,305.30	499,809,131.99	18.45
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险： 1、大额申购风险 在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。 2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险： （1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险； （2）如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； （3）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平； （4）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动； （5）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略； （6）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。 本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。							

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

2026 年 10 月 27 日