

景顺长城四季金利债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告

2024 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2024 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 月 19 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 1 月 1 日起至 2024 年 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城四季金利债券
场内简称	无
基金主代码	000181
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 7 月 30 日
报告期末基金份额总额	2,103,611,705.68 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</p> <p>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>(1) 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>(2) 债券投资策略:债券投资在保证资产流动性的基础</p>

	上，采取利率预期策略、信用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、权益资产投资策略 (1) 股票投资策略:本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略,本基金将从定性及定量两个方面加以考察分析投资标的; (2) 权证投资策略:本基金不直接购买权证等衍生品资产,但有可能持有所持股票所派发的权证或因投资分离交易可转债而产生的权证等。本基金管理人将以价值分析为基础,在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上,结合权证的溢价率、隐含波动率等指标选择权证的卖出时机。	
业绩比较基准	中证综合债券指数。	
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	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	景顺长城四季金利债券 A 类	景顺长城四季金利债券 C 类
下属分级基金的交易代码	000181	000182
报告期末下属分级基金的份额总额	2,095,223,407.16 份	8,388,298.52 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1月1日-2024年3月31日)	
	景顺长城四季金利债券 A 类	景顺长城四季金利债券 C 类
1. 本期已实现收益	21,600,893.46	166,206.07
2. 本期利润	19,456,191.38	116,192.29
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0102	0.0072
4. 期末基金资产净值	2,432,447,230.84	9,617,576.70
5. 期末基金份额净值	1.161	1.147

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

景顺长城四季金利债券 A 类

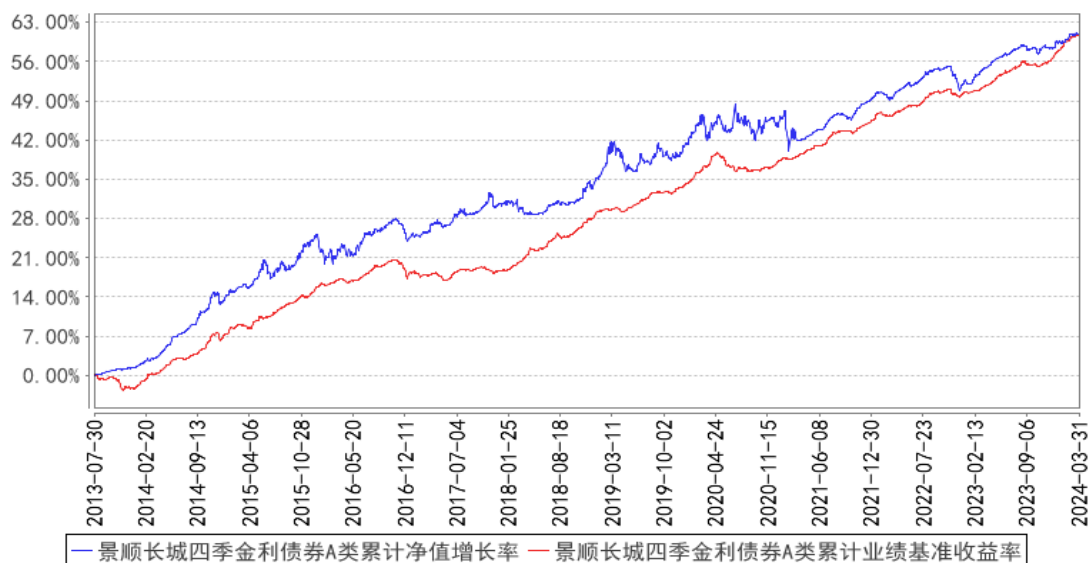
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.87%	0.08%	2.09%	0.07%	-1.22%	0.01%
过去六个月	1.57%	0.08%	3.45%	0.06%	-1.88%	0.02%
过去一年	3.86%	0.07%	6.02%	0.06%	-2.16%	0.01%
过去三年	13.38%	0.08%	15.24%	0.05%	-1.86%	0.03%
过去五年	14.71%	0.19%	23.70%	0.06%	-8.99%	0.13%
自基金合同生效起至今	60.94%	0.20%	60.83%	0.07%	0.11%	0.13%

景顺长城四季金利债券 C 类

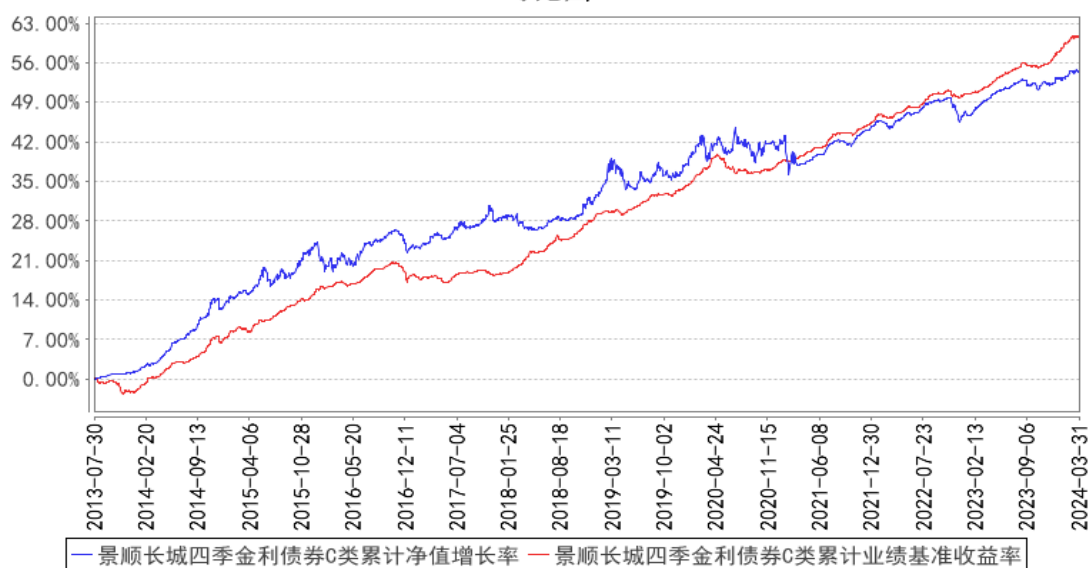
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.88%	0.08%	2.09%	0.07%	-1.21%	0.01%
过去六个月	1.51%	0.09%	3.45%	0.06%	-1.94%	0.03%
过去一年	3.49%	0.08%	6.02%	0.06%	-2.53%	0.02%
过去三年	12.01%	0.08%	15.24%	0.05%	-3.23%	0.03%
过去五年	12.39%	0.19%	23.70%	0.06%	-11.31%	0.13%
自基金合同生效起至今	54.58%	0.20%	60.83%	0.07%	-6.25%	0.13%

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

景顺长城四季金利债券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



景顺长城四季金利债券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：景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金基金合同已于 2013 年 7 月 30 日生效，2015 年 5 月 7 日至 6 月 7 日基金管理人以通讯开会方式召开基金份额持有人大会，大会表决通过了《关于调整景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金投资范围、投资策略、基金收益分配原则相关事项的议案》，调整后的基金更名为景顺长城四季金利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），其基金合同于 2015 年 6 月 10 日生效。调整后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%。调整后，本基金的建仓期为 2015 年 6 月 10 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合符合基金合同的有关约定。

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		
彭成军	本基金的基金经理	2021 年 4 月 2 日	-	17 年	理学硕士。曾任光大银行资金部交易员，民生银行金融市场部投资管理中心和交易中心总经理助理，东方基金管理有限责任公司总经理助理、固定收益投资总监、基金经理。2019 年 5 月加入本公司，自 2020 年 9 月起担任固定收益部基金经理，现任固定收益部总经理、基金经理。具有 17 年证券、基金行业从业经验。
张健	本基金的基金助理	2023 年 8 月 25 日	-	9 年	金融硕士，CFA、FRM。曾任国家外汇管理局中央外汇业务中心投资部策略师、组合经理助理，华泰证券股份有限公司研究所固定收益研究员。2023 年 6 月加入本公司，担任固定收益部基金经理助理。具有 9 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、《景顺长城四季金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 6 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

国内方面，2024 年 1-2 月经济数据较大幅度超出市场预期，生产端表现尤其强劲。工业增加值同比增长 7%，大幅强于市场预期的 4.3%，季调环比增速也显著偏强，服务业生产指数保持较高增速，同比增长 5.8%。从需求力量来看，出口显著超预期或是生产走强的主要驱动。1-2 月出口以美元计价同比增长 7.1%，大幅强于市场预期的 1.8%，环比增速也显著强于季节性规律，为历史最大值，生产与出口走强行业高度重合，意味着出口带动生产走强。消费延续温和修复，社会消费品零售总额同比增速 5.5%，较去年全年的两年复合增速 3.5%提升 2 个百分点，服务零售额同比 12.3%，服务消费保持火热，服务消费火热也带动了核心 CPI 走强，2 月核心 CPI 同比上涨 1.2%，为 2022 年 2 月以来最高涨幅。虽然核心 CPI 表现较强，在结构性产能过剩的背景下，总体价格依然面临较大压力，1-2 月总体 PPI 和 CPI 分别为-2.7%和 0%。固定资产投资韧性较强，1-2 月同比增长 4.2%，较去年全年增速 3%提升 1.2 个百分点，主要受制造业投资和基建投资的高增长驱动，房地产对经济的拖累依旧持续，销售端和投资端都没有改善。在我国 GDP 核算以生产法为主的背景下，生产的强劲决定了一季度 GDP 大概率能实现较强开局，预计能够实现 5%以上的同比增长。海外方面，联储 3 月 FOMC 决议将基准利率维持在 5.25%-5.5%区间。展望二季度，出口的较强表现预计能够持续，全球制造业 PMI 今年 1 月份是 15 个月以来首次回到扩张区间，且连续两个月保持扩张，全球制造业周期的企稳回升叠加美国的补库周期有望带动外需的持续改善。今年一季度地方专项债发行明显偏慢，二季度有望加速发行，叠加超长期国债也有望在二季度落地，基建投资的实物工作量有望明显改善，带动基建投资保持韧性。虽然房地产未见明显起色，322 国常会提出“系统谋划相关支持政策”，后续增量政策的出台或能带动地产投资和销售的边际改善。海外

方面，联储后续决策主要取决于数据，特别是通胀数据的走势，若 3-4 月通胀重新回到偏弱走势，基准情形下，联储仍可能 6 月启动降息周期。由于联储决策反应函数存在一定不对称，通胀数据的表现后续较为重要。我们认为，1-2 月通胀数据的回升部分受到 BLS 调整权重和 1 月效应等因素扰动，预计强势难以持续，但如果通胀数据回升超预期，联储降息预期或进一步推迟。

债券方面，资金面整体宽松，但分层现象较为明显，市场给予的信用债风险溢价较高。长端方面，在当前的基本面预期下，债券市场尚无大的调整风险，但偏低的收益意味着长端可能仍然面临一定的颠簸。信用债方面，短端具有票息价值，长端利差保护偏弱。在信用资产荒的预期下，信用利差持续压缩，信用利差保护偏弱，更为看好短端信用。在利差压缩到极致过后，城投长期基本面并未发生根本性扭转，不过度追涨弱区域城投。此外，关注二永等品种与城投债相对价值变化，优化组合结构。策略方面，组合整体采用杠杆策略。以短端信用作为底仓，中短端利率债作为套息及交易品种，信用债控制久期，并在相对价值的变化中调整仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2024 年 1 季度，景顺长城四季金利债券 A 类份额净值增长率为 0.87%，业绩比较基准收益率为 2.09%。

2024 年 1 季度，景顺长城四季金利债券 C 类份额净值增长率为 0.88%，业绩比较基准收益率为 2.09%。

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	3,283,297,287.11	97.70
	其中：债券	3,283,297,287.11	97.70
	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	20,800,000.00	0.62
	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	38,332,443.63	1.14
8	其他资产	18,329,328.73	0.55
9	合计	3,360,759,059.47	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	51,395,684.93	2.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	609,662,120.67	24.97
	其中：政策性金融债	273,195,634.33	11.19
4	企业债券	1,150,480,441.74	47.11
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,103,566,670.12	45.19
7	可转债（可交换债）	368,192,369.65	15.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,283,297,287.11	134.45

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	2120089	21 北京银行永续债 01	1,200,000	127,426,622.95	5.22
2	200305	20 进出 05	1,250,000	126,501,027.40	5.18
3	200404	20 农发 04	900,000	95,301,540.98	3.90
4	2023005	20 平安人寿	800,000	83,707,200.00	3.43
5	102382644	23 晋能煤业 MTN007	700,000	72,415,114.75	2.97

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

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分局的处罚。

中国平安人寿保险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分支行的处罚。

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	54,289.83

2	应收证券清算款	18,267,963.72
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,075.18
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	18,329,328.73

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	127045	牧原转债	15,577,424.55	0.64
2	118031	天 23 转债	12,976,057.21	0.53
3	123107	温氏转债	11,635,664.08	0.48
4	113666	爱玛转债	11,384,211.68	0.47
5	127068	顺博转债	10,957,489.91	0.45
6	113640	苏利转债	9,918,491.55	0.41
7	118023	广大转债	8,751,364.22	0.36
8	113049	长汽转债	8,630,795.31	0.35
9	127075	百川转 2	8,579,212.56	0.35
10	123151	康医转债	8,546,456.40	0.35
11	118032	建龙转债	8,191,873.39	0.34
12	118026	利元转债	7,668,311.45	0.31
13	128109	楚江转债	6,895,917.36	0.28
14	127041	弘亚转债	6,762,235.66	0.28
15	123161	强联转债	6,726,243.03	0.28
16	127049	希望转 2	6,651,702.98	0.27
17	127026	超声转债	6,627,422.28	0.27
18	123168	惠云转债	6,449,782.26	0.26
19	123124	晶瑞转 2	6,425,999.15	0.26
20	118000	嘉元转债	6,019,936.61	0.25
21	123119	康泰转 2	5,757,548.71	0.24
22	128136	立讯转债	5,431,993.15	0.22
23	118022	锂科转债	5,403,936.12	0.22
24	127077	华宏转债	5,255,153.99	0.22
25	123144	裕兴转债	5,223,181.48	0.21
26	113652	伟 22 转债	5,200,090.41	0.21
27	113655	欧 22 转债	5,173,762.59	0.21
28	113641	华友转债	5,060,177.40	0.21
29	127060	湘佳转债	4,997,023.70	0.20
30	113657	再 22 转债	4,945,624.73	0.20
31	118034	晶能转债	4,833,887.49	0.20
32	110089	兴发转债	4,824,483.93	0.20

33	123113	仙乐转债	4,783,300.72	0.20
34	113054	绿动转债	4,705,554.84	0.19
35	111010	立昂转债	4,503,834.52	0.18
36	118013	道通转债	4,209,804.94	0.17
37	111009	盛泰转债	4,177,655.88	0.17
38	110095	双良转债	3,920,862.71	0.16
39	113053	隆 22 转债	3,873,416.05	0.16
40	123154	火星转债	3,723,445.13	0.15
41	118029	富淼转债	3,227,257.24	0.13
42	127031	洋丰转债	3,205,847.36	0.13
43	128117	道恩转债	3,098,564.87	0.13
44	110081	闻泰转债	3,090,372.33	0.13
45	123169	正海转债	3,085,096.66	0.13
46	113046	金田转债	3,030,692.54	0.12
47	113650	博 22 转债	2,962,101.34	0.12
48	113050	南银转债	2,944,853.83	0.12
49	110073	国投转债	2,932,388.99	0.12
50	118020	芳源转债	2,882,361.16	0.12
51	127056	中特转债	2,690,564.13	0.11
52	123165	回天转债	2,612,523.97	0.11
53	113653	永 22 转债	2,597,620.55	0.11
54	127052	西子转债	2,546,681.51	0.10
55	123155	中陆转债	2,500,317.26	0.10
56	123146	中环转 2	2,433,644.55	0.10
57	113659	莱克转债	2,320,185.62	0.10
58	127070	大中转债	2,276,990.80	0.09
59	110082	宏发转债	2,158,794.52	0.09
60	127017	万青转债	2,147,026.52	0.09
61	123149	通裕转债	2,115,078.69	0.09
62	123128	首华转债	2,091,102.54	0.09
63	127073	天赐转债	1,915,869.73	0.08
64	110075	南航转债	1,796,747.21	0.07
65	127085	韵达转债	1,769,228.82	0.07
66	110086	精工转债	1,669,277.63	0.07
67	127086	恒邦转债	1,626,872.93	0.07
68	128144	利民转债	1,620,961.61	0.07
69	111001	山玻转债	1,495,324.44	0.06
70	127066	科利转债	1,491,490.37	0.06
71	127022	恒逸转债	1,423,419.48	0.06
72	123115	捷捷转债	1,411,967.58	0.06
73	110076	华海转债	1,316,119.60	0.05
74	118019	金盘转债	1,280,840.49	0.05

75	123106	正丹转债	1,272,515.10	0.05
76	127071	天箭转债	1,119,130.07	0.05
77	113059	福莱转债	1,116,863.01	0.05
78	123216	科顺转债	981,231.21	0.04
79	127069	小熊转债	938,705.12	0.04
80	123133	佩蒂转债	928,312.20	0.04
81	128097	奥佳转债	864,494.40	0.04
82	113623	凤 21 转债	821,357.84	0.03
83	123219	宇瞳转债	769,380.90	0.03
84	118008	海优转债	756,656.13	0.03
85	127020	中金转债	728,961.07	0.03
86	123145	药石转债	728,359.27	0.03
87	113545	金能转债	526,977.63	0.02
88	113062	常银转债	515,917.11	0.02
89	123122	富瀚转债	464,269.72	0.02
90	118039	煜邦转债	439,209.76	0.02
91	123179	立高转债	386,224.55	0.02
92	113644	艾迪转债	330,329.21	0.01
93	128119	龙大转债	255,971.33	0.01
94	110087	天业转债	103,477.12	0.00
95	127039	北港转债	73,196.91	0.00
96	110084	贵燃转债	52,586.38	0.00
97	127040	国泰转债	50,986.75	0.00
98	113061	拓普转债	35,774.65	0.00
99	127067	恒逸转 2	9,999.70	0.00
100	113051	节能转债	5,673.67	0.00
101	113602	景 20 转债	3,465.10	0.00
102	128138	侨银转债	2,349.84	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	景顺长城四季金利债券 A 类	景顺长城四季金利债券 C 类
报告期期初基金份额总额	1,815,589,663.13	26,802,042.86
报告期期间基金总申购份额	551,224,859.17	968,808.20

减: 报告期期间基金总赎回份额	271, 591, 115. 14	19, 382, 552. 54
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	2, 095, 223, 407. 16	8, 388, 298. 52

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

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	20240101-20240331	891, 381, 367. 37	-	-	891, 381, 367. 37	42. 37

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

根据《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》和《景顺长城四季金利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，景顺长城四季金利债券型证券投资基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司经与本基金的基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，以通讯开会方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议通过了关于调整本基金收益与分配条款的议案，调整后的收益与分配条款自 2024 年 2 月 7 日起生效。有关详细信息参见本基金管理人发布的一系列相关公告。

§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四季金利纯债债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城四季金利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城四季金利债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城四季金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

2024 年 4 月 22 日