

# 景顺长城货币市场证券投资基金 2019 年年度报告

2019 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 20 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	18
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>46</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	46

8.2 债券回购融资情况.....	46
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	46
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	47
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	48
8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细.....	48
8.9 投资组合报告附注.....	48
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	50
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	51
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>51</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	51
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
11.4 基金投资策略的改变.....	52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	54
11.9 其他重大事件.....	54
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>60</b>
12.1 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.....	60
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
13.1 备查文件目录.....	61
13.2 存放地点.....	61
13.3 查阅方式.....	62

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城货币市场证券投资基金	
基金简称	景顺长城货币	
场内简称	无	
基金主代码	260102	
系列基金名称	景顺长城景系列开放式证券投资基金	
系列其他子基金名称	景顺长城优选混合(260101)、景顺长城动力平衡混合(260103)	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年10月24日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,391,720,853.00份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B
下属分级基金的交易代码	260102	260202
报告期末下属分级基金的份 额总额	4,250,081,343.78份	141,639,509.22份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	货币市场基金在保持本金的高流动性和安全性的前提下，获得高于基准的投资回报。
投资策略	本基金通过宏观经济、政策和市场资金供求的综合分析进行短期利率判断，对各投资品种从收益率、流动性、信用风险、平均剩余期限等方面进行综合价值比较，在保持基金资产高流动性的前提下构建组合。
业绩比较基准	税后同期7天存款利率。
风险收益特征	本基金具有低风险和收益稳定的特点，投资目标是在保持本金的高流动性和安全性的前提下，获得高于基准的投资回报。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
		许俊
		010-66594319
		fcid@bankofchina.com

客户服务热线	4008888606	95566
传真	0755-22381339	010-66594942
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518048	100818
法定代表人	丁益	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

# §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据 和指 标	2019 年		2018 年		2017 年	
	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B
本期 已实 现收 益	26,877,652.69	3,536,623.42	9,995,218.71	8,504,623.40	10,176,462.15	33,444,998.66
本期 利润	26,877,652.69	3,536,623.42	9,995,218.71	8,504,623.40	10,176,462.15	33,444,998.66
本期 净值 收益 率	2.3033%	2.5472%	3.1547%	3.4020%	3.7174%	3.9653%
3.1.2 期末 数据	2019 年末		2018 年末		2017 年末	

和指标						
期末基金资产净值	4,250,081,343.78	141,639,509.22	368,394,493.55	248,921,312.24	460,349,717.77	609,084,636.54
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
累计净值收益率	47.4664%	35.7160%	44.1464%	32.3451%	39.7387%	27.9914%

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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、自 2019 年 6 月 17 日起本基金的收益分配方式由每日分配，按月结转份额改为每日分配，按日结转份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.5868%	0.0017%	0.3403%	0.0000%	0.2465%	0.0017%
过去六个月	1.1715%	0.0034%	0.6805%	0.0000%	0.4910%	0.0034%
过去一年	2.3033%	0.0033%	1.3500%	0.0000%	0.9533%	0.0033%
过去三年	9.4530%	0.0033%	4.0500%	0.0000%	5.4030%	0.0033%

过去五年	15.3079%	0.0049%	6.7500%	0.0000%	8.5579%	0.0049%
自基金运作起 始日起至今	47.4664%	0.0062%	25.4863%	0.0020%	21.9801%	0.0042%

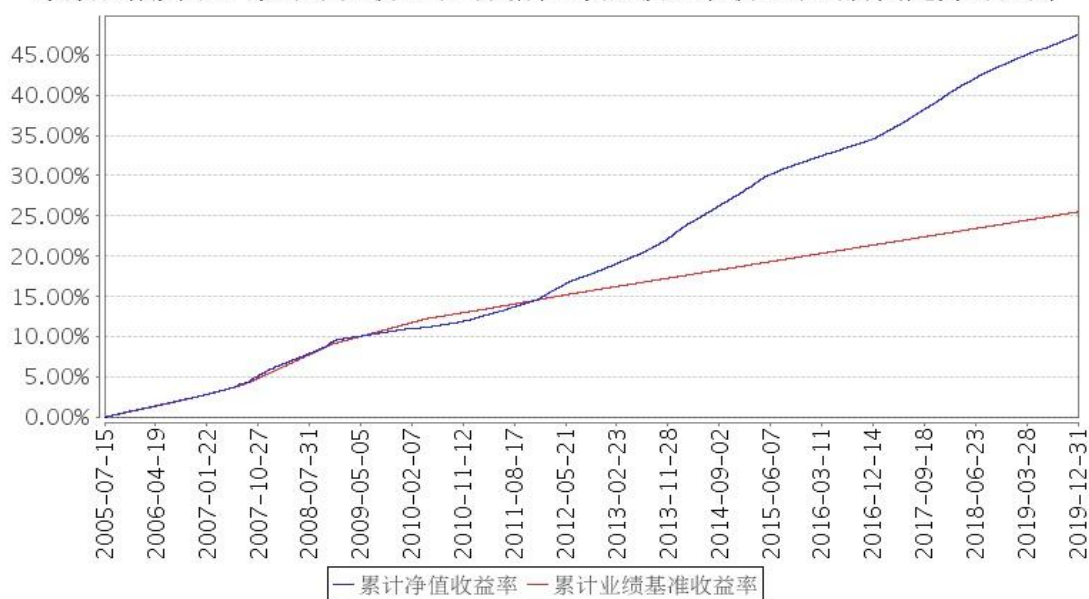
## 景顺长城货币 B

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 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	0.6475%	0.0017%	0.3403%	0.0000%	0.3072%	0.0017%
过去六个月	1.2923%	0.0034%	0.6805%	0.0000%	0.6118%	0.0034%
过去一年	2.5472%	0.0033%	1.3500%	0.0000%	1.1972%	0.0033%
过去三年	10.2399%	0.0033%	4.0500%	0.0000%	6.1899%	0.0033%
过去五年	16.6954%	0.0050%	6.7500%	0.0000%	9.9454%	0.0050%
自基金分级起 至今	35.7160%	0.0057%	13.2373%	0.0001%	22.4787%	0.0056%

注：自 2019 年 6 月 17 日起本基金的收益分配方式由每日分配，按月结转份额改为每日分配，按日结转份额。

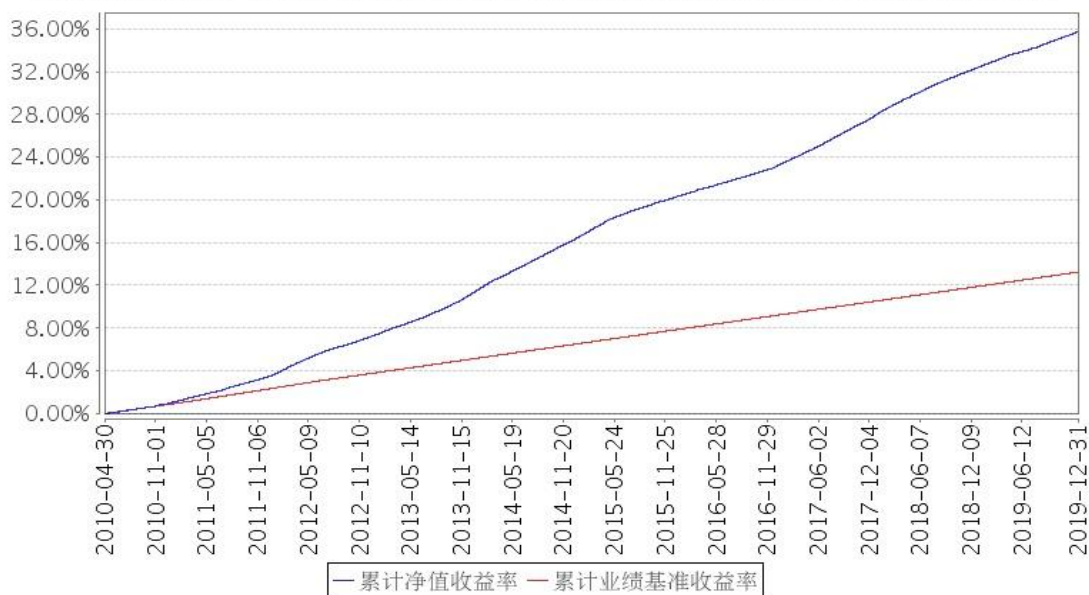
### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

景顺长城货币 A 累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





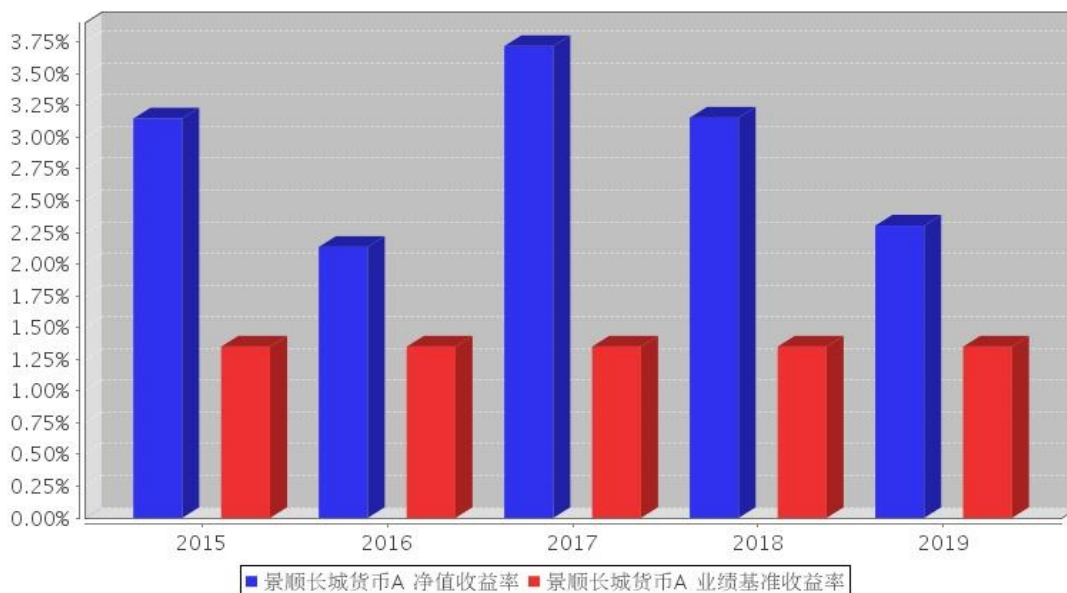
景顺长城货币B 累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



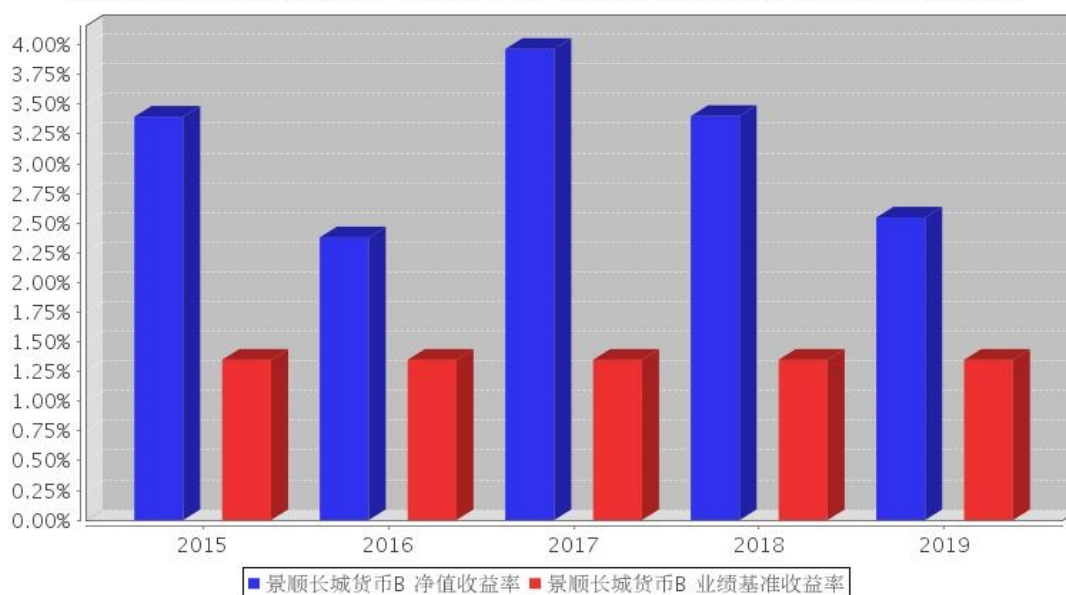
注:经景顺长城恒丰债券证券投资基金基金份额持有人大会表决通过,并于2005年7月7日获中国证券监督管理委员会证监基金字2005[121]号文核准,景顺长城恒丰债券证券投资基金以2005年7月14日为转变基准日转变成为景顺长城货币市场证券投资基金。本基金自2010年4月30日起实行基金份额分级。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城货币A 基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



景顺长城货币B 基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

景顺长城货币 A

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2019 年	26,836,941.57	386,929.16	-346,218.04	26,877,652.69	-
2018 年	9,725,746.73	904,356.10	-634,884.12	9,995,218.71	-
2017 年	9,006,924.74	468,466.05	701,071.36	10,176,462.15	-
合计	45,569,613.04	1,759,751.31	-280,030.80	47,049,333.55	-

景顺长城货币 B

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2019 年	3,056,783.40	663,696.25	-183,856.23	3,536,623.42	-
2018 年	8,300,740.55	1,338,264.58	-1,134,381.73	8,504,623.40	-
2017 年	30,294,802.86	3,876,603.36	-726,407.56	33,444,998.66	-
合计	41,652,326.81	5,878,564.19	-2,044,645.52	45,486,245.48	-

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会

会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截至2019年12月31日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理83只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金(QDII)、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证TMT150交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证TMT150交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城政策性金

融债债券型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化小盘股票型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金、景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景泰鑫利纯债债券型证券投资基金、景顺长城智能生活混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金、景顺长城集英成长两年定期开放混合型证券投资基金、景顺长城量化港股通股票型证券投资基金、景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金、景顺长城绩优成长混合型证券投资基金、景顺长城中短债债券型证券投资基金、景顺长城中证沪港深红利成长低波动指数型证券投资基金、景顺长城稳健养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城创新成长混合型证券投资基金、景顺长城景泰纯利债券型证券投资基金、景顺长城养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城弘利 39 个月定期开放债券型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈威霖	本基金的基金经理	2016 年 4 月 20 日	-	8	管理学硕士。曾担任平安利顺货币经纪公司债券市场部债券经纪人。2013 年 6 月加入本公司，历任交易管理部交易员、固定收益部信用研究员，自 2016 年 4 月起担任固定收益部基金经理。
米良	本基金的基金经理	2018 年 11 月 3 日	-	5	经济学硕士。曾担任汇丰银行（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 月加入我公司，自

					2018 年 11 月起担任固定收益部基金经理。
--	--	--	--	--	--------------------------

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。

#### 4.2 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》、《证券投资基金销售管理办法》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、《景顺长城景系列开放式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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人(以下简称“本公司”)投资和交易管理,严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见(2011年修订)》等法律法规,本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》,该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下:

##### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度,明确各投资决策主体的职责和权限划分;建立客观的研究方法,任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持,避免主观臆断,严禁利用内幕信息作为投资依据;确保所有投资组合平等地享有研究成果;根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等,建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库,投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

##### 2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度,将投资管理职能和交易执行职能相隔离;建立公平的交易分配机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,

严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

### 4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理及绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

#### 4.3.2 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投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金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 77 次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，公司旗下指数基金因指数成份股调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间虽然存在临近交易日同向交易行为和银行间债券 5 日内反向交易，但结合交易时机及市场交易价格波动分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。投资组合间虽然存在相邻反向异常交易，经分析为投资组合开放期内投资者连续赎回导致的被动行为，非不

公平交易和利益输送的异常交易行为。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年内外部环境变化较快，货币政策相机抉择微调频繁但总体稳健，政策重点在于稳增长，促进宽信用传导以降低实体经济融资成本。数量工具上，“全面降准+定向降准”相结合，同时年中贷款市场报价利率（LPR）定价机制改革的落地使得货币政策传导机制更为顺畅。价格型工具上，11 月份中期借贷便利及公开市场逆回购利率分别下调 5BP 以引导实体融资利率的下行。

分时间段来看，一季度中美贸易摩擦缓和、金融数据向好、风险偏好逐步提升等多方面乐观因素下，货币政策逐步转向稳健偏紧。5 月份始中美贸易摩擦升级及月底包商事件下，央行及时降准对冲加大流动性投放力度，同时银行间隔夜加权利率维持在 1%历史低位以缓解中小银行流动性及信用风险。三季度外汇流出压力加大且预期高通胀下，货币政策稳中略收紧。四季度经济下行压力加大，央行于 11 月分别下调中期借贷便利及公开市场逆回购利率各 5BP，明确开启新一轮政策宽松，证实了货币政策未受高通胀制约，货币政策重点仍在稳增长。

资金面上，以 DR007 为代表的短端价格全年基本上围绕 2.7%附近波动，相对于 18 年 3%左右的中枢明显下降。同业存单收益率相对 18 年同样有所下行，在资金面较为平稳的情况下，3 个月存单基本围绕这 2.8%的中枢上下波动，而 1 年期品种存单收益率更为稳定，全年在 3%-3.3%范围内窄幅波动，11 月央行超预期下调中期借贷便利和公开市场利率后，长端上行空间进一步压缩。全年来看，央行确保了银行间流动性松紧适度，资金面合理充裕，并坚持不搞大水漫灌，个别时点上的宽松并未改变货币政策维持稳健中性的总基调。

报告期内组合严格遵循公募流动性新规中对于货币基金操作的规定，在下半年收益率逐步上行过程中，组合多配置跨年存款拉长久期的同时避免负偏离。去年市场资金面波动较大，货币政策保持了松紧适度，组合也相应的灵活调整杠杆比率。虽然收益率曲线仍较为平坦，但考虑到组合负债端较为稳定，且预计明年央行仍将维持降息节奏，组合采用长久期策略。临近年末，收益率下行明显，组合久期略有下降，配置上以逆回购和短期债券为主。券种选择上，仍以高评级的信用债和同业存单为主，有效控制信用风险。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019 年度，景顺货币 A 类份额净值收益率为 2.3033%，业绩比较基准收益率为 1.3500%；

2019 年度，景顺货币 B 类份额净值收益率为 2.5472%，业绩比较基准收益率为 1.3500%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年，预计全球经济温和下行的趋势并未打破，中美之间达成阶段性贸易谈判有助于经济企稳，但年初中国突发新冠疫情，考虑到中国在世界产业链中的重要地位，这将对一季度乃至上半年全球经济基本面造成一定程度的负面影响。

国内方面，从政治局会议的定调来看，2020 年是“全面建成小康社会和‘十三五’规划收官之年”，在经济下行背景下，叠加年初新冠疫情的冲击，稳增长的诉求将更加强烈。疫情对宏观经济的负面冲击将维持 1-2 个季度，但并未改变中国经济长期向好、高质量发展的基本面，预计全年 GDP 增速仍能保持在接近 6%的水平，完成翻番目标。

明年经济稳增长诉求压力较大，因此逆周期调节政策也将更大力度的出台，以对冲疫情对经济的影响。财政政策与货币政策所形成的政策组合拳不可缺位，且需要提前发力。财政政策来看，地方债提前批额度已经下达，市场对于提高赤字率的讨论更加强烈；货币政策方面，强调“更加灵活适度”，解决实体经济融资难融资贵问题。虽然通胀压力有所减轻，在确保宏观经济杠杆率稳定的前提下，但仍不会采取“大水漫灌”方式，更多的以结构性货币政策工具为主，引导市场利率下行。产业政策方面，针对受疫情影响最大的消费和投资领域，未来重点关注汽车和家电消费政策的出台，在维持“房住不炒”的地产政策基调下，预计重大基建项目的推出将成为稳投资的重要抓手。

资金面方面，疫情引发的央行救济模式短期看难以退出，从宽货币向宽信用的传导路径已经确立，至少在经济企稳到来之前，流动性收紧的可能性不大。随着年初央行先后下调公开市场逆回购利率、中期借贷便利中标利率以及贷款市场报价利率 10bp，引导全年资金价格中枢下移，同时未来进一步下调货币政策工具利率甚至存款基准利率的空间仍在，以降低银行负债端成本，进而降低实体经济融资成本。现金管理类理财产品新规的推出，将提升货币市场上短久期品种需求，叠加政策利率下调，预计明年收益率曲线将平坦下行。

组合将密切关注宏观基本面数据、监管政策对时点上资金面的扰动以及央行货币政策操作，细致管理现金流。配置上仍将以绝对收益较高的同业存款和流动性较好的同业存单为主，并适量配置高等级信用债。短期内，货币市场资金面将保持合理充裕，组合维持较高的杠杆比例，待期限利差有所走阔后逐步拉长久期，提高组合收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽



核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在

遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性、适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司合作，由其提供相关固定收益品种的估值参考数据。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

自 2019 年 6 月 17 日起本基金的收益分配方式由“每日分配、按月支付”改为“每日分配、按日支付”。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

## **§5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城货币市场证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行

了应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

# §6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第 21494 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城货币市场证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城货币市场证券投资基金(以下简称“景顺长城货币市场基金”)的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了景顺长城货币市场基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>景顺长城货币市场基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估景顺长城货币市场基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算景顺长城货币市场基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督景顺长城货币市场基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对景顺长城货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致景顺长城货币市场基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>

会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	陈薇瑶
会计师事务所的地址	中国 上海市	
审计报告日期	2020 年 04 月 17 日	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城货币市场证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,713,724,136.82	121,367,274.22
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,712,654,940.75	348,542,748.62
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,712,654,940.75	348,542,748.62
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,135,749,703.63	85,801,128.70
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	16,323,603.06	3,123,424.69
应收股利		-	-
应收申购款		1,532,768.74	74,671,702.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,579,985,153.00	633,506,279.17
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		186,099,706.95	15,099,777.35
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		266,594.26	47,418.61
应付管理人报酬		765,647.82	126,181.75
应付托管费		153,129.57	38,236.88

应付销售服务费		741,603.55	67,963.53
应付交易费用	7.4.7.7	63,534.26	18,552.43
应交税费		67,671.58	59,613.03
应付利息		11,414.50	7,954.40
应付利润		-	530,074.27
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	94,997.51	194,701.13
负债合计		188,264,300.00	16,190,473.38
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	4,391,720,853.00	617,315,805.79
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		4,391,720,853.00	617,315,805.79
负债和所有者权益总计		4,579,985,153.00	633,506,279.17

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额总额 4,391,720,853.00 份，其中 A 级基金份额净值 1.0000 元，基金份额 4,250,081,343.78 份； B 级基金份额净值 1.0000 元，基金份额 141,639,509.22 份。

## 7.2 利润表

会计主体：景顺长城货币市场证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		38,847,908.93	22,107,096.01
1. 利息收入		37,543,214.67	21,836,939.04
其中：存款利息收入	7.4.7.11	18,929,380.49	9,909,632.66
债券利息收入		9,558,498.05	6,803,413.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,055,336.13	5,123,892.42
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,304,694.26	270,156.97
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,304,694.26	270,156.97
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
减：二、费用		8,433,632.82	3,607,253.90
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,466,580.08	1,851,401.98
2. 托管费	7.4.10.2.2	789,048.75	561,030.93
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,896,204.10	816,218.22
4. 交易费用	7.4.7.18	-	-
5. 利息支出		980,749.02	98,354.51
其中：卖出回购金融资产支出		980,749.02	98,354.51
6. 税金及附加		7,455.20	3,679.09
7. 其他费用	7.4.7.19	293,595.67	276,569.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,414,276.11	18,499,842.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,414,276.11	18,499,842.11

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城货币市场证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	617,315,805.79	-	617,315,805.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,414,276.11	30,414,276.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,774,405,047.21	-	3,774,405,047.21
其中：1. 基金申购款	34,930,415,413.06	-	34,930,415,413.06
2. 基金赎回款	-31,156,010,365.85	-	-31,156,010,365.85

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-30,414,276.11	-30,414,276.11
五、期末所有者权益(基金净值)	4,391,720,853.00	-	4,391,720,853.00
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,069,434,354.31	-	1,069,434,354.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,499,842.11	18,499,842.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-452,118,548.52	-	-452,118,548.52
其中：1. 基金申购款	2,313,516,670.79	-	2,313,516,670.79
2. 基金赎回款	-2,765,635,219.31	-	-2,765,635,219.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-18,499,842.11	-18,499,842.11
五、期末所有者权益(基金净值)	617,315,805.79	-	617,315,805.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

景顺长城景系列开放式证券投资基金(以下简称“本系列基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第96号《关于同意景顺长城景系列开放式证券投资基金设立的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》)发起,并于2003年10



月 24 日募集成立。本系列基金为契约型开放式，存续期限不定，目前下设三个子基金，分别为景顺长城货币市场证券投资基金(2005 年 7 月 15 日前原为景顺长城恒丰债券证券投资基金，以下简称“本基金”)、景顺长城优选股票证券投资基金和景顺长城动力平衡证券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,835,000,215.28 元，其中包括景顺长城恒丰债券证券投资基金人民币 473,468,816.63 元、景顺长城优选股票证券投资基金人民币 820,829,988.03 元和景顺长城动力平衡证券投资基金人民币 540,701,410.62 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2003)第 144 号验资报告予以验证。本系列基金设立募集期内认购资金产生的银行利息人民币 782,418.90 元在基金募集期结束时计入投资者认购账户，折合成 782,418.90 份基金份额，其中景顺长城恒丰债券证券投资基金 258,742.20 份基金份额、景顺长城优选股票证券投资基金 262,508.27 份基金份额和景顺长城动力平衡证券投资基金 261,168.43 份基金份额，归投资者所有。

根据基金管理人 2005 年 7 月 12 日发布的《关于景顺长城恒丰债券证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》(以下简称“公告”)，景顺长城恒丰债券证券投资基金的基金份额持有人大会于 2005 年 6 月 13 日表决通过了《关于景顺长城恒丰债券证券投资基金转变为景顺长城货币市场证券投资基金的议案》，并于 2005 年 7 月 7 日获得了中国证监会证监基金字[2005]121 号《关于核准景顺长城恒丰债券证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》。根据《关于景顺长城恒丰债券证券投资基金转变为景顺长城货币市场证券投资基金的议案》的有关规定，确定 2005 年 7 月 14 日为景顺长城恒丰债券证券投资基金的基金转变基准日，景顺长城恒丰债券证券投资基金需在此之前调整资产结构使之满足景顺长城货币市场证券投资基金的要求。

经普华永道中天会计师事务所有限公司审计(普华永道中天审字(2005)第 1720 号审计报告)，截至 2005 年 7 月 14 日止，景顺长城恒丰债券证券投资基金基金净值 81,561,919.51 元，于 2005 年 7 月 15 日按照本基金固定交易单位面值 1.00 元转变为本基金的基金净值和基金份额。景顺长城恒丰债券证券投资基金相关的资产和负债根据公告中规定的转变会计处理方法以直接结转和非直接结转的方法分别转变为本基金的资产和负债。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城景系列开放式证券投资基金下设的货币市场证券投资基金实施基金份额分级和变更业绩比较基准并修改相关基金合同的公告》，自 2010 年 4 月 30 日起，本基金将基金份额分为 A 级和 B 级，不同级别的基金份额适用不同费率的销售服务费。投资者基金账户所持有份额数量高于 500 万份(含)时，账户内所有基金份额归为 B 级，否则归为 A 级。基金份额分级后，在基金存续期内的任何一个开放日，注册登记机构根据上述分级原则对

投资者基金账户所持有份额的份额级别进行判断和处理。

根据《货币市场基金监督管理办法》和《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金、期限在一年以内(含一年)的银行存款、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、期限在一年以内(含一年)的同业存单、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的短期融资券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的中期票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的原业绩比较基准为：税后一年期定期存款利率，根据《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城景系列开放式证券投资基金下设的货币市场证券投资基金实施基金份额分级和变更业绩比较基准并修改相关基金合同的公告》，本基金的业绩比较基准自 2010 年 4 月 30 日起变更为：税后同期七天存款利率。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2020 年 4 月 17 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计

算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### **7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量**

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收

益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并分配，每日集中支付。

#### 7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确

定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
活期存款	2,724,136.82	667,274.22
定期存款	1,711,000,000.00	120,700,000.00
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	452,000,000.00	-
存款期限3个月至1年	1,259,000,000.00	120,700,000.00
存款期限1年以上	-	-
其他存款	-	-
合计	1,713,724,136.82	121,367,274.22

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	1,712,654,940.75	1,714,053,000.00	1,398,059.25	0.0318
	合计	1,712,654,940.75	1,714,053,000.00	1,398,059.25	0.0318
资产支持证券		-	-	-	-
合计		1,712,654,940.75	1,714,053,000.00	1,398,059.25	0.0318
项目		上年度末 2018年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	348,542,748.62	348,818,000.00	275,251.38	0.0446
	合计	348,542,748.62	348,818,000.00	275,251.38	0.0446
资产支持证券		-	-	-	-
合计		348,542,748.62	348,818,000.00	275,251.38	0.0446

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,135,749,703.63	-
合计	1,135,749,703.63	-
项目	上年度末 2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	85,801,128.70	-
合计	85,801,128.70	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	575.71	181.01
应收定期存款利息	5,985,820.76	872,570.74
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	8,919,458.17	2,068,065.76
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	1,417,748.42	182,607.18
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	16,323,603.06	3,123,424.69

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。



## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	63,534.26	18,552.43
合计	63,534.26	18,552.43

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	997.51	701.13
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	94,000.00	194,000.00
合计	94,997.51	194,701.13

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 景顺长城货币 A

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	368,394,493.55	368,394,493.55
本期申购	33,023,366,285.64	33,023,366,285.64
本期赎回(以“-”号填列)	-29,141,679,435.41	-29,141,679,435.41
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,250,081,343.78	4,250,081,343.78

## 景顺长城货币 B

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	248,921,312.24	248,921,312.24
本期申购	1,907,049,127.42	1,907,049,127.42
本期赎回(以“-”号填列)	-2,014,330,930.44	-2,014,330,930.44
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-

本期末	141,639,509.22	141,639,509.22
-----	----------------	----------------

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	26,877,652.69	-	26,877,652.69
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-26,877,652.69	-	-26,877,652.69
本期末	-	-	-
景顺长城货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	3,536,623.42	-	3,536,623.42
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,536,623.42	-	-3,536,623.42
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	13,182.84	12,740.95
定期存款利息收入	18,916,197.65	9,896,877.57
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	14.14
其他	-	-
合计	18,929,380.49	9,909,632.66

#### 7.4.7.12 股票投资收益

不适用。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,164,895,296.62	1,288,554,412.42
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,139,438,645.44	1,279,295,831.87
减：应收利息总额	24,151,956.92	8,988,423.58
买卖债券差价收入	1,304,694.26	270,156.97

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

不适用。

#### 7.4.7.15 股利收益

不适用。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

不适用。

#### 7.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

#### 7.4.7.18 交易费用

本基金本报告期内及上年度可比期间无交易费用。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	85,000.00	85,000.00
信息披露费	40,000.00	100,000.00
证券出借违约金	-	-
债券托管账户维护费	37,200.00	37,350.00
银行划款手续费	81,395.67	53,635.09
其他	50,000.00	584.08
合计	293,595.67	276,569.17

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司(“长城证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应付关联方佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,466,580.08	1,851,401.98
其中:支付销售机构的客户维护费	1,897,094.92	500,849.28

注:自2018年1月1日至2019年7月28日,支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

根据基金份额持有人大会表决通过的《景顺长城基金管理有限公司关于调整景顺长城货币市场证券投资基金的基金管理费率和基金托管费率并修改基金合同的公告》,自2019年7月29日起,支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	789,048.75	561,030.93

注：自2018年1月1日至2019年7月28日，支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

根据基金份额持有人大会表决通过的《景顺长城基金管理有限公司关于调整景顺长城货币市场证券投资基金的基金管理费率和基金托管费率并修改基金合同的公告》，自2019年7月29日起，支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019年1月1日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城货币A	景顺长城货币B	合计
景顺长城基金管理有限公司	26,383.71	4,381.10	30,764.81
中国银行	62,974.06	982.32	63,956.38
长城证券	1,107.65	-	1,107.65
合计	90,465.42	5,363.42	95,828.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018年1月1日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城货币A	景顺长城货币B	合计
景顺长城基金管理有限公司	34,668.59	15,474.87	50,143.46
中国银行	41,641.81	943.76	42,585.57
长城证券	675.01	-	675.01
合计	76,985.41	16,418.63	93,404.04

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 级基金基金份额和 B 级基金基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给景顺长城基金管理有限公司，再由景顺长城基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 级基金基金份额和 B 级基金基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日对应级别基金资产净值} \times \text{对应级别约定年费率} / \text{当年天数}$$

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B
基金合同生效日（2003 年 10 月 24 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B
基金合同生效日（2003 年 10 月 24 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	21,794,148.20
期间申购/买入总份额	662,855.65	55,363,965.94

期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	662,855.65	77,158,114.14
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：固有资金投资持有本基金 A/B 类基金份额，期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额；报告期末持有的基金份额占比为占 A/B 类基金总份额的比例。

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行—活期	2,724,136.82	13,182.84	667,274.22	12,740.95
中国银行—定期	100,000,000.00	3,196,490.18	-	-

注：本基金的活期银行存款和部分定期存款由基金托管人中国银行保管，活期存款按银行同业利率计息，定期存款按协议利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

景顺长城货币 A				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
26,836,941.57	386,929.16	-346,218.04	26,877,652.69	-
景顺长城货币 B				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
3,056,783.40	663,696.25	-183,856.23	3,536,623.42	-

**7.4.12 期末(2019 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截止本报告期末 2019 年 12 月 31 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 186, 099, 706. 95 元, 是以如下债券作为抵押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
180202	18 国开 02	2020 年 1 月 2 日	100. 19	600, 000	60, 115, 127. 38
190302	19 进出 02	2020 年 1 月 2 日	99. 99	700, 000	69, 996, 362. 44
190405	19 农发 05	2020 年 1 月 2 日	99. 91	500, 000	49, 953, 378. 69
199934	19 贴现国债 34	2020 年 1 月 2 日	99. 73	100, 000	9, 973, 094. 80
合计				1, 900, 000	190, 037, 963. 31

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截止本报告期末, 本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**7.4.13 金融工具风险及管理****7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念, 将风险管理融入业务中, 建立了以风险管理委员会为核心, 由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人, 对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

**7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或者基金所投资证券的发行人



出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 32.17%（上年末：49.96%）。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

##### **7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种（企业债或短期融资券），并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资

组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于本期末，本基金前 10 名份额持有人的合计占比为 2.79%（扣除固有资金投资之后的比例），本基金投资组合的平均剩余期限为 65 天，平均剩余存续期为 65 天。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### **7.4.13.4 市场风险**

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>							
银行存款	122,724,136.82	1,313,000,000.00	278,000,000.00	-	-	-	1,713,724,136.82
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	740,153,046.29	488,787,698.86	483,714,195.60	-	-	-	1,712,654,940.75
买入返售金融资产	776,173,604.26	359,576,099.37	-	-	-	-	1,135,749,703.63
应收利息	-	-	-	-	-	16,323,603.06	16,323,603.06
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,532,768.74	1,532,768.74
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-0.00	-0.00
<b>资产总计</b>	<b>1,639,050,787.37</b>	<b>2,161,363,798.23</b>	<b>761,714,195.60</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>17,856,371.80</b>	<b>4,579,985,153.00</b>
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	266,594.26	266,594.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	765,647.82	765,647.82
应付托管费	-	-	-	-	-	153,129.57	153,129.57
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	186,099,706.95	-	-	-	-	-	186,099,706.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-	741,603.55	741,603.55
应付交易费用	-	-	-	-	-	63,534.26	63,534.26
应付利息	-	-	-	-	-	11,414.50	11,414.50
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	67,671.58	67,671.58
其他负债	-	-	-	-	-	94,997.51	94,997.51
<b>负债总计</b>	<b>186,099,706.95</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2,164,593.05</b>	<b>188,264,300.00</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>1,452,951,080.42</b>	<b>2,161,363,798.23</b>	<b>761,714,195.60</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>							
<b>资产</b>							
银行存款	667,274.22	56,600,000.00	64,100,000.00	-	-	-	121,367,274.22
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	39,983,839.43	149,834,206.88	158,724,702.31	-	-	-	348,542,748.62
买入返售金融资产	85,801,128.70	-	-	-	-	-	85,801,128.70
应收利息	-	-	-	-	-	3,123,424.69	3,123,424.69
应收股利	-	-	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-	74,671,702.94	74,671,702.94
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	126,452,242.35	206,434,206.88	222,824,702.31	-	-	77,795,127.63	633,506,279.17
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	47,418.61	47,418.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	126,181.75	126,181.75
应付托管费	-	-	-	-	-	38,236.88	38,236.88
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	15,099,777.35	-	-	-	-	-	15,099,777.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-	67,963.53	67,963.53
应付交易费用	-	-	-	-	-	18,552.43	18,552.43
应付利息	-	-	-	-	-	7,954.40	7,954.40
应付利润	-	-	-	-	-	530,074.27	530,074.27
应交税费	-	-	-	-	-	59,613.03	59,613.03
其他负债	-	-	-	-	-	194,701.13	194,701.13
负债总计	15,099,777.35	-	-	-	-	1,090,696.03	16,190,473.38
利率敏感度缺口	111,352,465.00	206,434,206.88	222,824,702.31	-	-	-	-

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-801,504.80	-217,897.32
	市场利率下降 25 个基点	802,994.46	218,238.23

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低

其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### **7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

本期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同）。

#### **7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

本期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同），因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### **7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 1,712,654,940.75 元，无属于第一或第三层次的余额（2018 年 12 月 31 日：第二层次 348,542,748.62 元，无第一或第三层次）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2018 年 12 月 31 日：同）。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允

价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	1,712,654,940.75	37.39
	其中：债券	1,712,654,940.75	37.39
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,135,749,703.63	24.80
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,713,724,136.82	37.42
4	其他各项资产	17,856,371.80	0.39
5	合计	4,579,985,153.00	100.00

注：银行存款和结算备付金合计中包含定期存款 1,711,000,000.00 元。

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.27	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	186,099,706.95	4.24
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	65
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	91
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内，本货币基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	37.32	4.24
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	27.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	21.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	2.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	15.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	103.88	4.24

### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内，本货币基金投资组合平均剩余期限未超过 240 天。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	89,910,250.57	2.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	210,057,292.52	4.78
	其中：政策性金融债	210,057,292.52	4.78
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	530,334,268.75	12.08
6	中期票据	-	-
7	同业存单	882,353,128.91	20.09
8	其他	-	-
9	合计	1,712,654,940.75	39.00
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	111909418	19 浦发银行 CD418	1,500,000	149,400,633.50	3.40
2	111917015	19 光大银行 CD015	1,000,000	99,640,091.50	2.27
3	111905220	19 建设银行 CD220	1,000,000	98,643,651.01	2.25
4	011901605	19 宝钢 SCP012	800,000	80,119,874.93	1.82
5	071900111	19 华泰证券 CP005	800,000	80,043,528.06	1.82
6	071900126	19 海通证券 CP003	800,000	80,020,951.46	1.82
7	199942	19 贴现国债 42	800,000	79,937,155.77	1.82
8	071900122	19 中信 CP010	700,000	70,048,381.06	1.60
9	011902600	19 光大集团 SCP016	700,000	70,010,089.75	1.59
10	190302	19 进出 02	700,000	69,996,362.44	1.59

### 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1290%
报告期内偏离度的最低值	-0.0008%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0478%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内，本货币基金未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内，本货币基金未发生正偏离度的绝对值达到 0.50%的情况。

### 8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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。

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值为 1.0000 元。



### 8.9.2 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

1、上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”，股票代码：600000）于 2019 年 12 月 11 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书（沪银保监银罚决字〔2019〕87 号）。其信用卡中心信用卡催收外包管理严重违反审慎经营规则，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项的相关规定，被处以罚款人民币 50 万元。

2019 年 7 月 17 日，浦发银行信用卡中心因在为部分客户办理信用卡业务时，对申请人收入核定严重不审慎的问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项的相关规定，收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书（沪银保监银罚决字〔2019〕53 号），被处以罚款人民币 30 万元。

2019 年 6 月 24 日，浦发银行因对成都分行授信业务及整改情况严重失察；重大审计发现未向监管部门报告；轮岗制度执行不力的问题，违反了《中华人民共和国商业银行法》第六十条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关内控管理的规定，收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字〔2019〕7 号），被处以 130 万元罚款。

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浦发银行同业存单进行了投资。

2、中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”，股票代码：601939、0939.HK）于 2019 年 7 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书（沪银保监银罚决字〔2019〕54 号）。其信用卡中心因在为部分客户办理信用卡业务时，未遵守总授信额度管理制度；对部分信用卡申请人资信水平调查严重不尽职的问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项的相关规定，被处以罚款人民币 30 万元。

2019 年 7 月 17 日，建设银行信用卡中心因部分信用卡资金违规用于非消费领域，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项的相关规定，收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书（沪银保监银罚决字〔2019〕24 号），被处以罚款人民币 50 万元。

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建设银行同业存单进行了投资。

3、其余八名证券的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。

**8.9.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	16,323,603.06
4	应收申购款	1,532,768.74
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	17,856,371.80

**8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

**§9 基金份额持有人信息****9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
景顺长城货币 A	1,422,376	2,988.02	43,550,588.96	1.02	4,206,530,754.82	98.98
景顺长城货币 B	15	9,442,633.95	20,203,662.94	14.26	121,435,846.28	85.74
合计	1,422,391	3,087.56	63,754,251.90	1.45	4,327,966,601.10	98.55

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

**9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况**

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例(%)
1	个人	26,616,127.84	0.61
2	个人	15,963,251.52	0.36
3	个人	11,040,480.55	0.25
4	券商类机构	10,777,827.93	0.25
5	个人	10,513,435.60	0.24
6	个人	10,503,399.54	0.24
7	基金类机构	10,110,018.93	0.23
8	个人	9,556,359.34	0.22
9	个人	8,967,539.60	0.20
10	个人	8,298,042.26	0.19

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	景顺长城货币 A	103,509.03	0.0024
	景顺长城货币 B	-	-
	合计	103,509.03	0.0024

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

**9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

1. 本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
2. 本期末本基金的基金经理未持有本基金。

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B
基金运作起始日（2005 年 7 月 15 日）基金份额总额	81,561,919.51	-
本报告期期初基金份额总额	368,394,493.55	248,921,312.24
本报告期基金总申购份额	33,023,366,285.64	1,907,049,127.42
减：本报告期基金总赎回份额	29,141,679,435.41	2,014,330,930.44
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,250,081,343.78	141,639,509.22

注：总申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额，总赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

**§11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

景顺长城货币市场证券投资基金于 2019 年 5 月 21 日至 2019 年 6 月 13 日以通讯开会方式召开基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于调整景顺长城货币市场证券投资基金的收益与分配、投资限制并修改基金合同有关事项的议案》。该议案自 2019 年 6 月 14 日起生效。本次持有人大会决议生效后，根据持有人大会通过的议案及方案说明，《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》关于对本基金的收益与分配、投资限制调整于 2019 年 6 月 17 日生效。有关详

细信息参见本基金管理人于 2019 年 5 月 13 日至 2019 年 6 月 15 日发布的一系列相关公告。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 2020 年 1 月 22 日发布公告，因丁益董事长退休，由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。

2、本基金管理人于 2020 年 3 月 6 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任李黎女士担任本公司副总经理。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。2019 年 6 月，刘连舸先生任中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已经连续 17 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 85,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注:1. 基金专用交易单元的选择标准和程序如下:

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

2. 本基金本期交易单元未变更。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于暂停直销网上交易系统快速赎回业务和现金宝快速取现业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-01-10
2	景顺长城货币市场证券投资基金收益支付公告（2019 年第 1 号）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-01-15
3	景顺长城货币市场证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-01-21
4	景顺长城基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-01-30
5	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-02-01
6	景顺长城货币市场证券投资基金收益支付公告（2019 年第 2 号）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-02-15
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-02-23

8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳盈信基金销售有限公司基金转换费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-02-27
9	景顺长城货币市场证券投资基金收益支付公告（2019 年第 3 号）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-03-15
10	景顺长城货币市场证券投资基金 2018 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-03-26
11	景顺长城货币市场证券投资基金 2018 年年度报告摘要	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-03-26
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-03
13	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-04
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增玄元保险为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-04
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-08
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-11
17	景顺长城货币市场证券投资基金收益支付公告（2019 年第 4 号）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-15
18	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-16
19	景顺长城货币市场证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-20
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-05-09
21	景顺长城基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开景顺长城货币市场证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-05-13

22	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-05-13
23	景顺长城基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开景顺长城货币市场证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-05-14
24	景顺长城货币市场证券投资基金收益支付公告（2019 年第 5 号）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-05-15
25	景顺长城基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开景顺长城货币市场证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-05-15
26	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-05-20
27	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-04
28	景顺长城景系列开放式证券投资基金 2019 年第 1 号更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-06
29	景顺长城景系列开放式证券投资基金 2019 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-06
30	关于调整景顺长城货币市场证券投资基金基金份额升降级规则的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-14
31	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下景顺长城货币市场证券投资基金 A 级、B 级基金份额首次申购、定期定额投资、转换转出最低份额和最低持有份额数额限制的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-14
32	景顺长城景系列开放式证券投资基金 2019 年第 2 号更新招募说明书摘要	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-15
33	景顺长城基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-15
34	景顺长城货币市场证券投资基金收益支付公告（2019 年第 6 号）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-15
35	景顺长城基金管理有限公司关于景顺	中国证券报、基金管理	2019-06-15



	长城货币市场证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	人网站、证监会基金电子披露网站	
36	景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-15
37	景顺长城景系列开放式证券投资基金托管协议	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-15
38	景顺长城景系列开放式证券投资基金 2019 年第 2 号更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-15
39	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-25
40	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统中国工商银行渠道暂停服务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-26
41	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信证券等多家销售机构基金转换费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-01
42	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-05
43	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-09
44	景顺长城货币市场证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-17
45	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海天天基金销售有限公司认/申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-18
46	景顺长城基金管理有限公司关于调整景顺长城货币市场证券投资基金的基金管理费率和基金托管费率并修改基金合同的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-29
47	景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-29
48	景顺长城景系列开放式证券投资基金托管协议	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-29

49	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金在直销网上交易系统开展转换费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-02
50	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江网商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-05
51	景顺长城货币市场证券投资基金限制壹仟万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）及转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-05
52	景顺长城基金管理有限公司澄清公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-06
53	景顺长城基金管理有限公司关于提醒直销网上交易系统个人投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-16
54	景顺长城基金管理有限公司关于提醒直销网上交易系统个人投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-17
55	景顺长城基金管理有限公司关于提醒直销网上交易系统个人投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-19
56	景顺长城货币市场证券投资基金 2019 年半年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-23
57	景顺长城货币市场证券投资基金 2019 年半年度报告摘要	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-23
58	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-30
59	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在嘉实财富开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-09-05
60	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统中国农业银行渠道暂停服务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-09-20
61	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在平安证券开通基金转换业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-09-26
62	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证券报、基金管理	2019-10-22

	基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	人网站、证监会基金电子披露网站	
63	景顺长城货币市场证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-10-22
64	景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-05
65	景顺长城景系列开放式证券投资基金托管协议	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-05
66	景顺长城景系列开放式证券投资基金 2019 年第 3 号更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-05
67	景顺长城景系列开放式证券投资基金 2019 年第 3 号更新招募说明书摘要	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-05
68	关于景顺长城基金管理有限公司旗下 80 只基金修改基金合同、托管协议并更新招募说明书的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-05
69	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-03
70	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-05
71	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-05
72	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统中国工商银行渠道暂停服务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-12
73	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-13
74	景顺长城景系列开放式证券投资基金 2019 年第 4 号更新招募说明书摘要	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-23
75	景顺长城景系列开放式证券投资基金 2019 年第 4 号更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-23
76	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-24

77	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在微动利开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-27
----	---	---------------------------	------------

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20190320-20190320	-	100,000,000.00	100,000,000.00	-	-

#### 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、景顺长城货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2019 年 5 月 21 日至 2019

年 6 月 13 日以通讯开会方式召开基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于调整景顺长城货币市场证券投资基金的收益与分配、投资限制并修改基金合同有关事项的议案》。该议案自 2019 年 6 月 14 日起生效。本次持有人大会决议生效后，根据持有人大会通过的议案及方案说明，《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》关于对本基金的收益与分配、投资限制调整于 2019 年 6 月 17 日生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2019 年 5 月 13 日至 2019 年 6 月 15 日发布的一系列相关公告。

2、景顺长城货币市场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银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定对本基金的管理费率和托管费率进行调整，将本基金的管理费率由 0.33%年费率调整为 0.25%年费率，托管费率由 0.10%年费率调整为 0.05%年费率。调整自 2019 年 7 月 29 日起生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2019 年 7 月 29 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于调整景顺长城货币市场证券投资基金的基金管理费率和基金托管费率并修改基金合同的公告》。

3、根据中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的要求，景顺长城基金管理有限公司对包括本基金在内的旗下 80 只公开募集开放式证券投资基金基金合同及托管协议中与“信息披露”相关的条款进行了修订。修订后的基金合同、托管协议已于 2019 年 11 月 5 日起生效。有关详细信息参见本公司于 2019 年 11 月 5 日发布的《关于景顺长城基金管理有限公司旗下 80 只基金修改基金合同、托管协议并更新招募说明书的提示性公告》。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城景系列开放式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城景系列开放式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城景系列开放式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。

### 13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 13.3 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

2020 年 4 月 20 日