# 景顺长城景益货币市场基金
# 2020年第2季度报告

2020年6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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2020年7月21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 2020 年 07 月 20 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 2020 年 04 月 01 日起至 2020 年 06 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 景顺长城景益货币 |
| 场内简称 | 无 |
| 基金主代码 | 000380 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013 年 11 月 26 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 107,171,281,703.36 份 |
| 投资目标 | 本基金在保持基金资产安全性和高流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，实现基金的安全稳定回报。 |
| 投资策略 | 本基金根据对短期利率变动的合理预判，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用定性分析和定量分析方法，综合分析宏观经济指标，包括全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平变动趋势、利率水平和市场预期、通货膨胀率、货币供应量等，对短期利率走势进行综合判断，同时分析央行公开市场操作、主流资金的短期投资倾向、债券供给、货币市场与资本市场资金互动等，并根据动态预期决定和调整组合的平均剩余期限。预期市场利率水平上升，适度缩短投资组合的平均剩余期限，以降低组合下跌风险；预期市场利率水平下降，适度延长投资组合的平均剩余期限，以分享债券价格上升的收益。 |
| 业绩比较基准 | 同期七天通知存款利率（税后） 。 |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品 |

| | | |
|---|---|---|
| | 种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。 | |
| 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 | 景顺长城景益货币 A | 景顺长城景益货币 B |
| 下属分级基金的交易代码 | 000380 | 000381 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 107,171,281,703.36 份 | -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（2020 年 4 月 1 日-2020 年 6 月 30 日） | |
|---|---|---|
| | 景顺长城景益货币 A | 景顺长城景益货币 B |
| 1.本期已实现收益 | 455,550,544.04 | 41,563.78 |
| 2.本期利润 | 455,550,544.04 | 41,563.78 |
| 3.期末基金资产净值 | 107,171,281,703.36 | - |

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、本报告期，本基金 B 类份额相关财务指标披露期间为 2020 年 4 月 1 日至 2020 年 5 月 17 日。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期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

景顺长城景益货币 A

| 阶段 | 净值收益率① | 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 | 0.4203% | 0.0005% | 0.3357% | 0.0000% | 0.0846% | 0.0005% |
| 过去六个月 | 0.9942% | 0.0010% | 0.6713% | 0.0000% | 0.3229% | 0.0010% |
| 过去一年 | 2.2016% | 0.0009% | 1.3519% | 0.0000% | 0.8497% | 0.0009% |
| 过去三年 | 8.9787% | 0.0027% | 4.0519% | 0.0000% | 4.9268% | 0.0027% |
| 过去五年 | 14.9097% | 0.0034% | 6.7519% | 0.0000% | 8.1578% | 0.0034% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.8858% | 0.0058% | 8.9045% | 0.0000% | 13.9813% | 0.0058% |

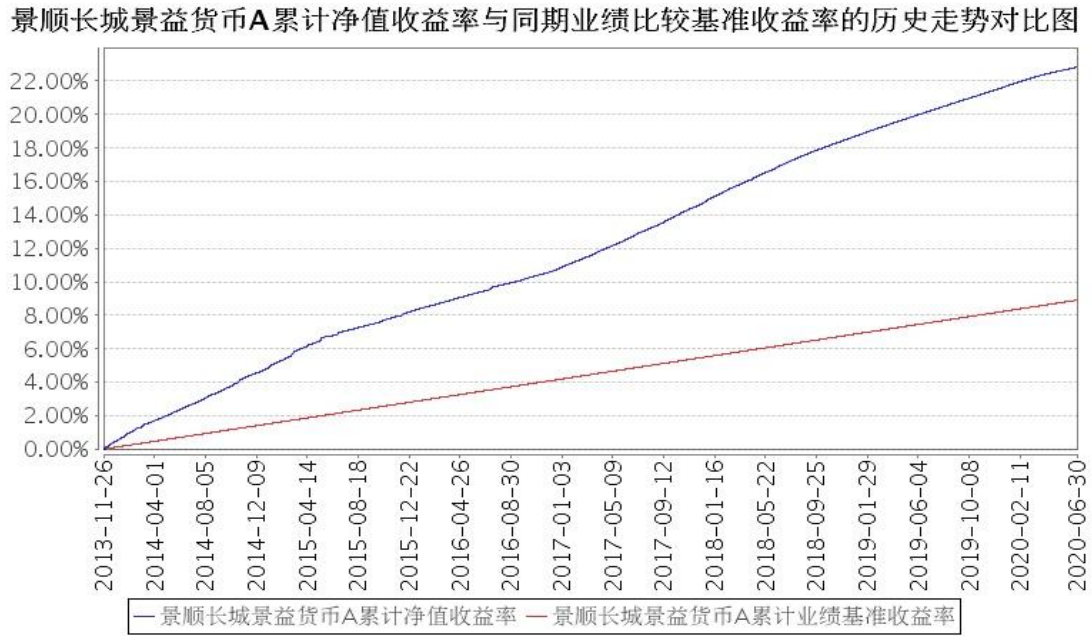
景顺长城景益货币 B

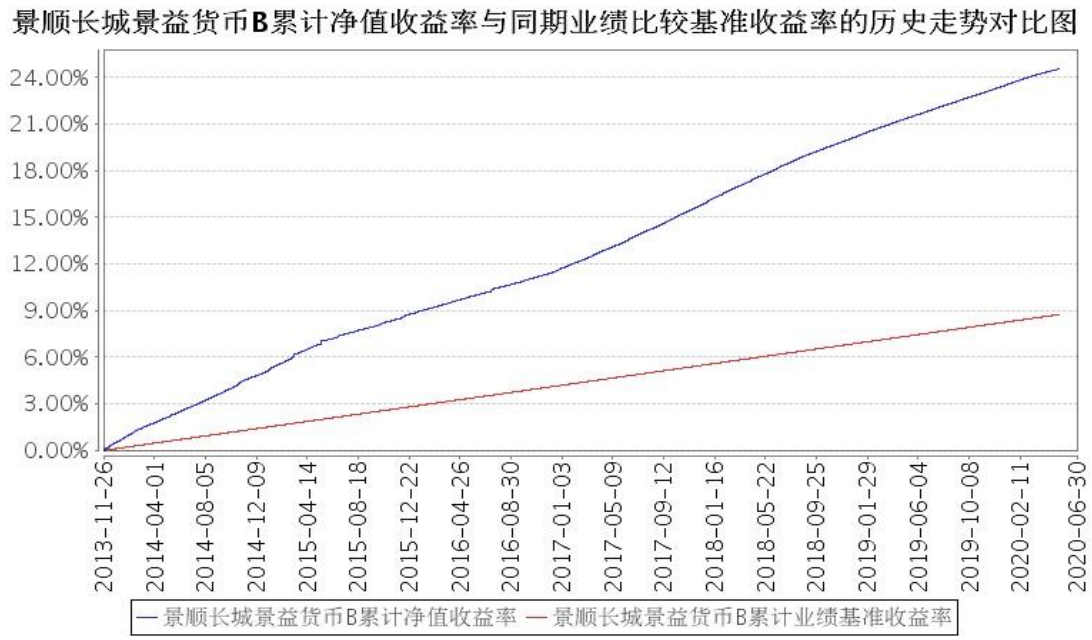
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差 | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|

| | | | | ④ | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.2534% | 0.0004% | 0.1734% | 0.0000% | 0.0800% | 0.0004% |
| 过去六个月 | 0.8865% | 0.0009% | 0.5090% | 0.0000% | 0.3775% | 0.0009% |
| 过去一年 | 2.2161% | 0.0008% | 1.1896% | 0.0000% | 1.0265% | 0.0008% |
| 过去三年 | 9.5157% | 0.0027% | 3.8896% | 0.0000% | 5.6261% | 0.0027% |
| 过去五年 | 16.0311% | 0.0035% | 6.5896% | 0.0000% | 9.4415% | 0.0035% |
| 自基金合同生效起至今 | 24.5604% | 0.0058% | 8.7422% | 0.0000% | 15.8182% | 0.0058% |

注：2015 年 7 月 15 日起，本基金的收益分配原则由“每日分配、按月支付”调整为“每日分配、按日支付”。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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






注：本基金的建仓期为自 2013 年 11 月 26 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投资组合比例的要求。

# §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 | 2018 年 11 月 3 日 | - | 6 年 | 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。 |
| 陈威霖 | 本基金的基金经理 | 2018 年 5 月 30 日 | - | 9 年 | 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。 |

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《景顺长城景益货币市场基金基金合同》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 9 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交易所证券临近交易日同向交易和银行间债券 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。

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

二季度货币政策总体基调宽松，但已然从对冲疫情的非常态模式下逐步收敛。而货币市场利率在政策引导下出现快速上行。具体来看，4 月央行货币政策非常积极，勇于担当，数量型货币政策工具结合价格型货币政策工具齐发力。央行于 4 月 3 日宣布对中小银行定向降准 1 个百分点，并下调金融机构在央行超额存款准备金利率 37bp 从 0.72%降至 0.35%。央行下调超额存款准备金利率此举大超市场预期，也是自 2008 年以来十年来首次下调。超额准备金利率代表着银行间利率走廊下限，下调此利率意味着打开了货币市场利率下行空间，货币市场利率 1Y 期受此影响随后大幅下行 40bp。4 月 15 日央行再度发力，降低 1Y 期 MLF 利率 20bp 继续带动 LPR 利率下行。货币财政政策大力支持下，4 月份开始宏观经济指标呈现良好回升迹象。货币政策也从最为宽松的对冲疫情非常态模式回归常态，同时央行开始重新考虑汇率及由前期隔夜加权利率过低导致的资金空转套利问题。5 月底央行重启公开市场逆回购，银行间隔夜加权利率大幅上行。货币市场利率在 6

月快速走高，1Y 期利率在前期低点上快速上行约 100bp。同时公开市场逆回购重启使得由央行供给的短端流动性增多，且地方债、国债等缴款使得 6 月以来资金面波动频率加大。整体资金面从 4 月非常宽松转为 6 月相对中性，资金利率方面平均隔夜加权利率从 4 月 1.03%位置快速回升至 6 月 1.9%左右。

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，同时就货币政策相机抉择组合策略上也相应灵活调整。一季度至 4 月央行宽松加码，组合策略上较为积极，将剩余期限持续保持在较长区间。而 5 月份货币政策工具量价两方面逐步出现细微变化，组合及时缩短剩余期限，卖出长期限资产。后续配置上以短期回购为主。6 月市场收益率大幅上行，组合保持较短剩余期限策略。

目前整体宏观场景已由“衰退”转向“复苏”，二季度实际 GDP 增速预计将反弹至 2%-3%，预计三季度将进一步修复至潜在增速附近，基建投资将进一步明显发力，政府债券继续发行也可能带动社融等指标继续上行。在“稳就业保民生”的核心诉求之下，关注三季度就业方面可能出现的脉冲式冲击，政策将如何应对也可能对相关行业造成影响。

货币政策应对疫情危机最给力时点已过，对于资本市场而言则是资金最便宜时点已过。未来货币政策预计将保持宽松，重点仍然是降低实体融资成本，但更多通过定向精准支持。政策目前汇率、房价、稳金融问题重回视野。未来一个季度，资金面上预计将保持合理充裕，但可以观察到目前央行在流动性供给上，公开市场逆回购量 5 月底重启后一直在逐步替换 MLF 供应量，中长期流动性供给在持续减少，资金面波动势必加大。而资金利率上，隔夜加权利率中枢目前回到 2 月底左右 1.8%位置，但以该利率对应的货币市场利率曲线仍然过于平坦，1 年品种仍然有继续上行空间，三季度预计期限利差或将走阔。同时由于部分银行压降结构性存款，负债端压力提高了银行对于长期限同业存单发行需求，资产端银行存在压缩同业资产意愿，比如赎回货币基金等，这些均可能将助推曲线保持趋势性向上。当然，目前货币政策回归常态后仍然是相机抉择，后续如若国内外疫情没有得到较好控制或是基本面数据转冷，央行仍有可能再次回到积极宽松状态。

组合将密切关注宏观基本面数据、国内外疫情影响以及央行货币政策操作，组合也将根据这些情况作出灵活调整。在收益率未达到合意水平前，配置上仍将以逆回购交易为主，并适量配置高等级信用债。等待收益率曲线逐步陡峭后再适当拉长组合剩余期限至中性。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

2020 年 2 季度，景顺长城景益货币 A 净值收益率为 0.4203%， 业绩比较基准收益率为 0.3357%。

2020 年 2 季度，景顺长城景益货币 B 净值收益率为 0.2534%， 业绩比较基准收益率为

0.1734%。

### 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 | 固定收益投资 | 19,833,643,910.15 | 18.19 |
| | 其中：债券 | 19,833,643,910.15 | 18.19 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 41,814,408,591.85 | 38.35 |
| | 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 | 46,754,204,639.91 | 42.88 |
| 4 | 其他资产 | 622,939,764.30 | 0.57 |
| 5 | 合计 | 109,025,196,906.21 | 100.00 |

注：银行存款和结算备付金合计中包含定期存款 46,032,000,000.00 元。

### 5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值比例（%） | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 5.37 | |
| | 其中：买断式回购融资 | - | |
| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金资产净值比例（%） |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 1,785,068,227.46 | 1.67 |
| | 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基金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%。

### 5.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 5.3.1 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 | 53 |

| | |
|---|---|
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 90 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 50 |

**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。

### 5.3.2 报告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 | 57.31 | 1.67 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 10.69 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 5.86 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 11.70 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 15.58 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 101.15 | 1.67 |

### 5.4 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。

### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 1,535,118,161.83 | 1.43 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 3,146,057,037.51 | 2.94 |
| | 其中：政策性金融债 | 3,146,057,037.51 | 2.94 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 6,712,823,145.93 | 6.26 |
| 6 | 中期票据 | 332,698,601.95 | 0.31 |
| 7 | 同业存单 | 8,106,946,962.93 | 7.56 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 19,833,643,910.15 | 18.51 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

### 5.6 报告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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量（张） | 摊余成本（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 200201 | 20国开01 | 7,000,000 | 700,997,036.64 | 0.65 |
| 2 | 209929 | 20贴现国债29 | 7,000,000 | 697,167,037.24 | 0.65 |
| 3 | 190307 | 19进出07 | 5,500,000 | 550,856,271.79 | 0.51 |
| 4 | 111909239 | 19浦发银行CD239 | 5,300,000 | 529,371,634.52 | 0.49 |
| 5 | 012000209 | 20电网SCP005 | 5,000,000 | 500,124,521.89 | 0.47 |
| 6 | 112016151 | 20上海银行CD151 | 5,000,000 | 499,276,490.63 | 0.47 |
| 7 | 111908174 | 19中信银行CD174 | 5,000,000 | 498,814,189.85 | 0.47 |
| 8 | 112092607 | 20北京农商银行CD034 | 5,000,000 | 498,061,648.25 | 0.46 |
| 9 | 170310 | 17进出10 | 4,800,000 | 480,989,199.71 | 0.45 |
| 10 | 041900341 | 19汇金CP006 | 3,800,000 | 380,786,165.87 | 0.36 |

## 5.7 “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 | 0.0530% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0018% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0277% |

### 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0.5%的情况。

## 5.8 报告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。

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 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

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。

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、中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”，股票代码：601998）于2019年8月9日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〕12号)。其因未按规定提供报表且逾期未改正；错报、漏报银行业监管统计资料；未向监管部门报告重要信息系统运营中断事件等多项问题，违反了《银行业监管统计管理暂行办法》（中国银监会令 2004年第6号）第八条、第三十六条，《流动资金贷款管理暂行办法》第九条、第三十九条等规定，被没收违法所得33.6677万元，罚款2190万元，合计2223.6677万元。

2020年4月20日，中信银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第47条等规定，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(2020)9号)，被处以160万元罚款。

2020年2月20日，中信银行因违规发放土地储备贷款；受托支付不符合监管规定等问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条等规定，收到中国银保监会北京监管局出具的行政处罚决定书(京银保监罚决字〔2020〕10号)，被处以2020万元罚款。

2020年3月，中信银行在未经客户本人授权的情况下，向第三方提供个人银行账户交易明细，违背为存款人保密的原则，涉嫌违反《中华人民共和国商业银行法》和银保监会关于个人信息保护的监管规定，严重侵害消费者信息安全权，损害了消费者合法权益，被立案调查。

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中信银行同业存单进行了投资。

3、北京农村商业银行股份有限公司于2020年2月28日收到北京银保监局出具的行政处罚决定书(京银保监罚决字〔2020〕13号)。其因贷款调查审查不尽职、违规发放土地储备贷款、贷款资金变相支付土地出让金、部分个贷业务违反北京市差别化住房信贷政策、员工行为管理薄弱的问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条的相关规定，被处以罚款人民币220万元。同时因错报小微贷款“1104”报表数据；违规审批、发放贷款；贷款资金被挪用；违规开展票据业务等问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条的相关规定，

收到北京银保监局出具的行政处罚决定书(京银保监罚决字〔2020〕5 号)，被处以 330 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北京农商行同业存单进行了投资。

4、上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”，股票代码：601229）于 2019 年 11 月 14 日收到中国人民银行上海分行出具的行政处罚决定书(上海银罚字〔2019〕22 号)。其因违反支付业务规定，被处没收违法所得 1,762,787.61 元，并处以 1,762,787.61 元罚款，共计 3,525,575.22 元。

2019 年 7 月 17 日，上海银行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，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）项的规定，收到上海银保监局出具的行政处罚决定书（沪银保监银罚决字(2019)52 号)，被处以 40 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上海银行同业存单进行了投资。

5、其余六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。

### 5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 617,078,546.18 |
| 4 | 应收申购款 | 5,860,358.86 |
| 5 | 其他应收款 | 859.26 |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 622,939,764.30 |

### 5.9.4 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 | 景顺长城景益货币 A | 景顺长城景益货币 B |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 112,036,170,620.85 | 15,658,950.29 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 574,048,368,528.00 | 19,569,827.60 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 578,913,257,445.49 | 35,228,777.89 |
| 报告期期末基金份额总额 | 107,171,281,703.36 | - |

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。

# §7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

# §8 影响投资者决策的其他重要信息

## 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

# §9 备查文件目录

## 9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城景益货币市场基金募集注册的文件；

2、《景顺长城景益货币市场基金基金合同》；

3、《景顺长城景益货币市场基金招募说明书》；

4、《景顺长城景益货币市场基金托管协议》；

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
2020 年 7 月 21 日