

# 景顺长城货币市场证券投资基金 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 7 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
报告期末基金份额总额	7,734,608,495.03 份
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。
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

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	7,569,259,958.43 份	165,348,536.60 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）	
	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B
1. 本期已实现收益	25,484,281.09	1,337,913.10
2. 本期利润	25,484,281.09	1,337,913.10
3. 期末基金资产净值	7,569,259,958.43	165,348,536.60

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。

#### 3.2 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	0.4128%	0.0013%	0.3357%	0.0000%	0.0771%	0.0013%
过去六个月	1.0111%	0.0018%	0.6713%	0.0000%	0.3398%	0.0018%
过去一年	2.1944%	0.0028%	1.3519%	0.0000%	0.8425%	0.0028%
过去三年	8.6871%	0.0033%	4.0519%	0.0000%	4.6352%	0.0033%
过去五年	14.2785%	0.0036%	6.7519%	0.0000%	7.5266%	0.0036%
自基金合同生效起至今	48.9573%	0.0061%	26.1576%	0.0020%	22.7997%	0.0041%

景顺长城货币 B

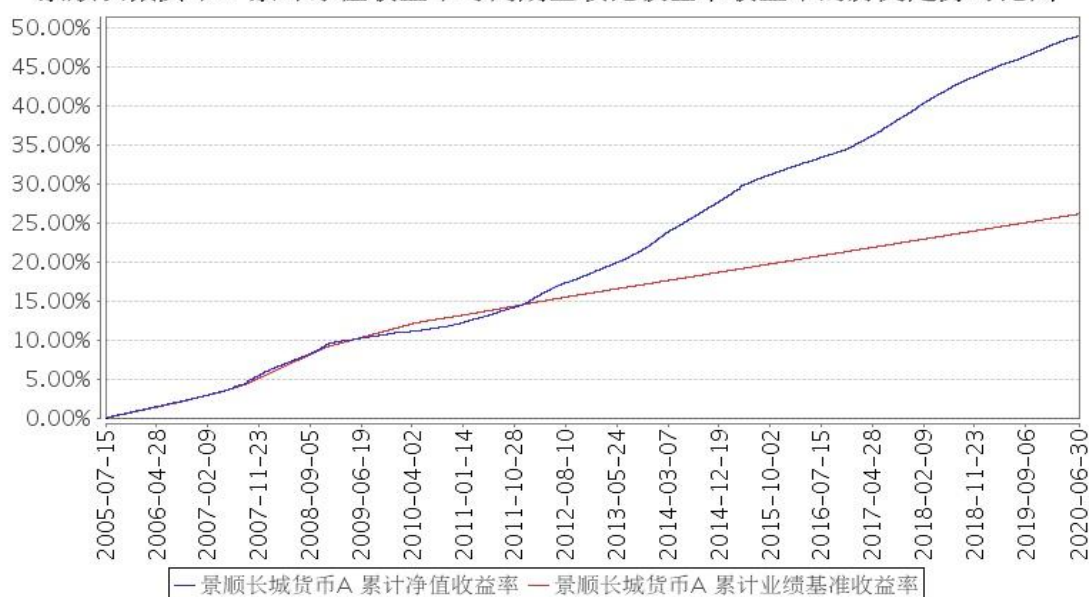
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.4725%	0.0013%	0.3357%	0.0000%	0.1368%	0.0013%
过去六个月	1.1313%	0.0018%	0.6713%	0.0000%	0.4600%	0.0018%
过去一年	2.4383%	0.0028%	1.3519%	0.0000%	1.0864%	0.0028%

过去三年	9.4689%	0.0033%	4.0519%	0.0000%	5.4170%	0.0033%
过去五年	15.6534%	0.0036%	6.7519%	0.0000%	8.9015%	0.0036%
自基金合同生效起至今	37.2514%	0.0056%	13.9086%	0.0001%	23.3428%	0.0055%

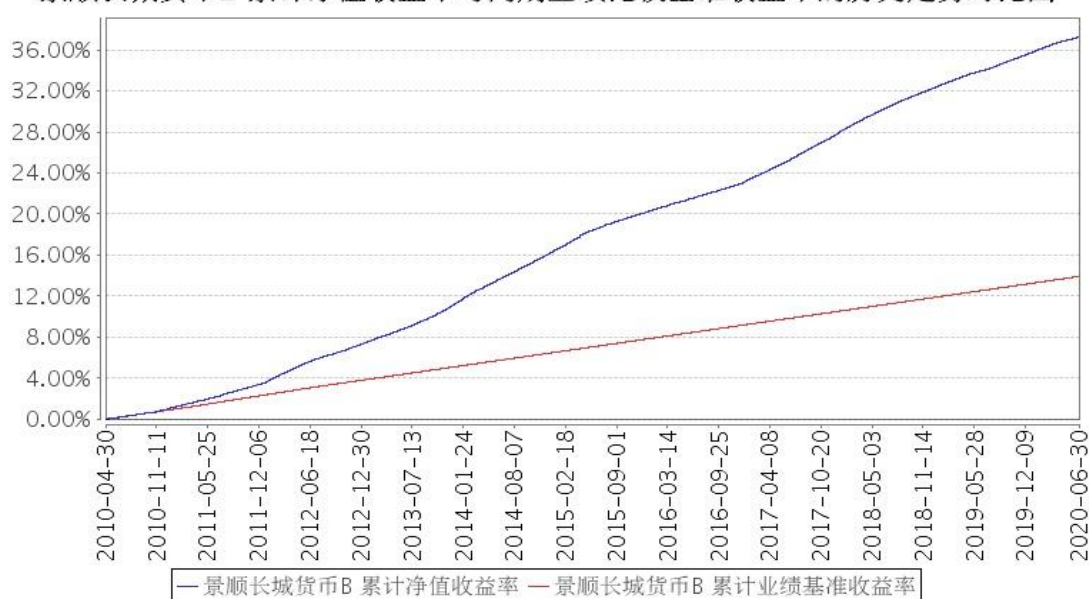
注：自 2019 年 6 月 17 日起本基金的收益分配方式由每日分配，按月结转份额改为每日分配，按日结转份额。

### 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。

## §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	2016 年 4 月 20 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”为根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”为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 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

二季度在复工复产推进的初期，各项经济指标的环比改善斜率将较大，当经济环比修复最快的阶段正在过去，整体上看年内经济仍是一个弱复苏的格局。在经济基本面恢复的过程中，货币政策正在逐步实现“正常化”，抗疫期间的极度宽松货币环境正逐步收敛，在公开市场操作以及降准降息工具的使用上面均较为克制，追求总量政策的适度。政策重心已由前期的宽货币逐步过渡到宽信用，央行意图通过改革、规范等方式降低银行负债成本、企业融资成本的决心较强，但降成本的实现预计仍需要央行货币政策方面的适当配合。

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%，从而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 报价下行。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，同时央行工作重新开始更多考虑汇率及由前期隔夜加权利率过低孳生的资金空转套利问题。5 月底央行重启公开市场逆回购操作，并有意引导银行间隔夜加权利率大幅上行。在降准降息政策落空后，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，隔夜加权利率的中枢也从 4 月 1.03% 位置快速回升至 6 月 1.9% 附近。

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，4 月份面对资金面异常宽松，资产价格大幅下行的局面，组合提高了杠杆比例以增强收益，配置上以回购和存款为主。5 月中旬之后，在收益率开始上行过程中及时卖出跨年资产，缩短组合久期，并在半年末时点收益

率上行阶段增配同业存单。考虑到期限利差较低，组合配置上仍以年内资产为主，因后期申购入款较多，组合久期并未明显增长。

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，其中基建投资将进一步明显发力，政府债券继续发行也将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、监管政策对时点上资金面的扰动以及央行货币政策操作，细致管理组合流动性。在收益率未达到合意水平前，配置上仍将以逆回购交易以及季度内到期的存款存单为主，并适量配置高等级信用债。随着收益率走高，同时期限利差有所加大后，组合将增配年内到期的存款存单，逐步拉长久期并降低杠杆比率。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2020 年 2 季度，景顺长城货币 A 类净值收益率为 0.4128%，业绩比较基准收益率为 0.3357%。

2020 年 2 季度，景顺长城货币 B 类净值收益率为 0.4725%，业绩比较基准收益率为 0.3357%。

#### 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	2,315,173,125.51	29.38
	其中：债券	2,315,173,125.51	29.38

	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	2,968,614,852.93	37.68
	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	2,548,653,883.38	32.35
4	其他资产	46,481,369.32	0.59
5	合计	7,878,923,231.14	100.00

注：银行存款和结算备付金合计中包含定期存款 2,546,000,000.00 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	4.62	
	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	141,159,729.42	1.83
	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%。

## 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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	84
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

### 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	54.68	1.83
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债	-	-
2	30 天 (含) — 60 天	23.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动	-	-



	利率债		
3	60 天（含）—90 天	6.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	5.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	11.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	101.26	1.83

#### 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	79,886,327.42	1.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	331,211,848.09	4.28
	其中：政策性金融债	331,211,848.09	4.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	350,552,565.49	4.53
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,553,522,384.51	20.09
8	其他	-	-
9	合计	2,315,173,125.51	29.93
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	170310	17 进出 10	1,500,000	150,316,203.61	1.94
2	112095446	20 广州农村商业银行 CD049	1,500,000	148,453,126.55	1.92
3	170209	17 国开 09	1,000,000	100,518,806.58	1.30
4	041900324	19 中石油 CP001	1,000,000	100,329,552.87	1.30
5	012000251	20 南航股 SCP002	1,000,000	100,131,860.83	1.29
6	012000132	20 浙能源 SCP002	1,000,000	100,090,380.31	1.29
7	111917054	19 光大银行 CD054	1,000,000	99,865,349.47	1.29
8	111907135	19 招商银行 CD135	1,000,000	99,840,758.12	1.29

9	111917059	19 光大银行 CD059	1,000,000	99,826,312.23	1.29
10	111912075	19 北京银行 CD075	1,000,000	99,736,635.24	1.29

## 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	0.0788%
报告期内偏离度的最低值	-0.0081%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0353%

### 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。

## 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、招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，股票代码：600036）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）51 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 20 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招商银行同业存单进行了投资。

2、北京银行股份有限公司（以下简称“北京银行”，股票代码：601169）于 2019 年 9 月 11 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[2019]28 号）。其因个人消费贷款被挪用于支付购房首付款或投资股权、个别个人商办用房贷款违反房地产调控政策、同业投资通过信托通道违规发放土地储备贷款等问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六

条的规定，被处以 110 万元罚款。

2019 年 9 月 25 日，北京银行因员工大额消费贷款违规行为长期未有效整改、同业业务专营部门制改革不到位、同业投资违规接受第三方金融机构信用担保的问题，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(2019)38 号)，被处以 100 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银行同业存单进行了投资。

3、中国光大银行股份有限公司（以下简称“光大银行”，股票代码：601818）于 2020 年 2 月 10 日收到中国人民银行出具的行政处罚决定书(银罚字（2020）14 号)。其因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易，被处以 1820 万元罚款。

2020 年 4 月 20 日，光大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 46 条, 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)5 号)，被处以 160 万元罚款。

2019 年 12 月 27 日，光大银行因授信审批不审慎、为还款来源不清晰的项目办理业务、总行对分支机构管控不力承担管理责任的问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条等规定，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（2019）23 号)，被处以 180 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光大银行同业存单进行了投资。

4、广州农村商业银行股份有限公司（以下简称“广州农商行”，股票代码：1551.HK）于 2019 年 10 月 25 日收到中国银保监会广东监管局出具的行政处罚决定书(粤银保监罚决字（2019）54 号)。其因违规向客户收取服务费的问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条第三款等相关规定，被处以罚款人民币 65 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广州农商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	40,492,544.33
4	应收申购款	5,988,824.99
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	46,481,369.32

#### 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	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B
报告期期初基金份额总额	5,969,654,849.49	152,342,497.94
报告期期间基金总申购份额	55,331,841,636.01	612,111,571.20
报告期期间基金总赎回份额	53,732,236,527.07	599,105,532.54
报告期期末基金份额总额	7,569,259,958.43	165,348,536.60

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

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	申赎	2020-04-10	9,000,000.00	9,000,000.00	-
2	申赎	2020-04-13	10,000,000.00	10,000,000.00	-
3	红利再投	2020-04-13	1,465.64	1,465.64	-
4	申赎	2020-04-14	10,000,000.00	10,000,000.00	-
5	红利再投	2020-04-14	976.69	976.69	-
6	申赎	2020-04-15	10,000,000.00	10,000,000.00	-
7	红利再投	2020-04-15	1,505.52	1,505.52	-
8	申赎	2020-04-16	10,000,000.00	10,000,000.00	-
9	红利再投	2020-04-16	2,040.24	2,040.24	-
10	申赎	2020-04-17	10,000,000.00	10,000,000.00	-

11	红利再投	2020-04-17	2,561.38	2,561.38	-
12	申赎	2020-04-20	10,000,000.00	10,000,000.00	-
13	红利再投	2020-04-20	11,843.45	11,843.45	-
14	申赎	2020-04-21	10,000,000.00	10,000,000.00	-
15	红利再投	2020-04-21	9,495.63	9,495.63	-
16	申赎	2020-04-22	10,000,000.00	10,000,000.00	-
17	红利再投	2020-04-22	4,398.26	4,398.26	-
18	申赎	2020-04-23	10,000,000.00	10,000,000.00	-
19	红利再投	2020-04-23	4,670.01	4,670.01	-
20	申赎	2020-04-24	10,000,000.00	10,000,000.00	-
21	红利再投	2020-04-24	4,956.89	4,956.89	-
22	申赎	2020-04-27	10,000,000.00	10,000,000.00	-
23	红利再投	2020-04-27	15,004.13	15,004.13	-
24	申赎	2020-04-28	10,000,000.00	10,000,000.00	-
25	红利再投	2020-04-28	5,435.30	5,435.30	-
26	申赎	2020-04-29	10,000,000.00	10,000,000.00	-
27	红利再投	2020-04-29	5,738.16	5,738.16	-
28	申赎	2020-04-30	10,000,000.00	10,000,000.00	-
29	红利再投	2020-04-30	6,199.08	6,199.08	-
30	申赎	2020-05-06	10,000,000.00	10,000,000.00	-
31	红利再投	2020-05-06	45,587.12	45,587.12	-
32	红利再投	2020-05-07	7,546.06	7,546.06	-
33	申赎	2020-05-08	10,000,000.00	10,000,000.00	-
34	红利再投	2020-05-08	7,674.11	7,674.11	-
35	申赎	2020-05-11	10,000,000.00	10,000,000.00	-
36	红利再投	2020-05-11	24,690.37	24,690.37	-
37	申赎	2020-05-12	10,000,000.00	10,000,000.00	-
38	红利再投	2020-05-12	8,796.67	8,796.67	-

39	申赎	2020-05-13	10,000,000.00	10,000,000.00	-
40	红利再投	2020-05-13	9,391.01	9,391.01	-
41	申赎	2020-05-14	10,000,000.00	10,000,000.00	-
42	红利再投	2020-05-14	9,840.20	9,840.20	-
43	申赎	2020-05-15	10,000,000.00	10,000,000.00	-
44	红利再投	2020-05-15	9,640.49	9,640.49	-
45	申赎	2020-05-18	10,000,000.00	10,000,000.00	-
46	红利再投	2020-05-18	32,192.62	32,192.62	-
47	申赎	2020-05-19	10,000,000.00	10,000,000.00	-
48	红利再投	2020-05-19	14,236.28	14,236.28	-
49	申赎	2020-05-20	10,000,000.00	10,000,000.00	-
50	红利再投	2020-05-20	11,224.45	11,224.45	-
51	申赎	2020-05-21	10,000,000.00	10,000,000.00	-
52	红利再投	2020-05-21	11,391.83	11,391.83	-
53	申赎	2020-05-22	10,000,000.00	10,000,000.00	-
54	红利再投	2020-05-22	11,783.65	11,783.65	-
55	申赎	2020-05-25	10,000,000.00	10,000,000.00	-
56	红利再投	2020-05-25	37,027.87	37,027.87	-
57	红利再投	2020-05-26	12,268.14	12,268.14	-
58	红利再投	2020-05-27	12,627.82	12,627.82	-
59	申赎	2020-05-28	10,000,000.00	-10,000,000.00	-
60	红利再投	2020-05-28	12,606.66	12,606.66	-
61	红利再投	2020-05-29	12,227.51	12,227.51	-
62	红利再投	2020-06-01	36,895.47	36,895.47	-
63	红利再投	2020-06-02	12,497.09	12,497.09	-
64	红利再投	2020-06-03	12,319.78	12,319.78	-
65	红利再投	2020-06-04	12,233.22	12,233.22	-
66	申赎	2020-06-04	24,553.00	-24,553.00	-

67	申赎	2020-06-04	269,416,435.80	-269,416,435.80	-
合计			558,881,977.60	0.00	

注：基金管理人本期运用自有资金投资本基金均为本基金的 B 类基金份额。

## §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。

### 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