景顺长城货币市场证券投资基金
2020年中期报告

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

送出日期：2020年8月24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。本中期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 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

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

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

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 8

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
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 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.8 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 15

§5 托管人报告 15

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15

6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 17
6.4 报表附注 19

§7 投资组合报告 36

7.1 期末基金资产组合情况 36
7.2 债券回购融资情况 36
7.3 基金投资组合平均剩余期限 37
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 37

7.6 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 38
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 38
7.8 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 38
7.9 投资组合报告附注 39

§8 基金份额持有人信息 40

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 40
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 41
8.4 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 41

§9 开放式基金份额变动 41

§10 重大事件揭示 42

10.1 基金份额持有人大会决议 42
10.2 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 42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 42
10.4 基金投资策略的改变 42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 43
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 44
10.9 其他重大事件 44

§11 影响投资者决策的其他重要信息 46

11.1 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 46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 46

§12 备查文件目录 46

12.1 备查文件目录 46
12.2 存放地点 46
12.3 查阅方式 47

§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	7,734,608,495.03 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	7,569,259,958.43 份	165,348,536.60 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	杨皞阳	许俊
	联系电话	0755-82370388	010-66594319
	电子邮箱	investor@igwfmc.com	fcid@bankofchina.com

客户服务电话	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfmc.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)	
	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B
本期已实现收益	55,808,126.01	2,311,876.51
本期利润	55,808,126.01	2,311,876.51
本期净值收益率	1.0111%	1.1313%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	7,569,259,958.43	165,348,536.60
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	48.9573%	37.2514%

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 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

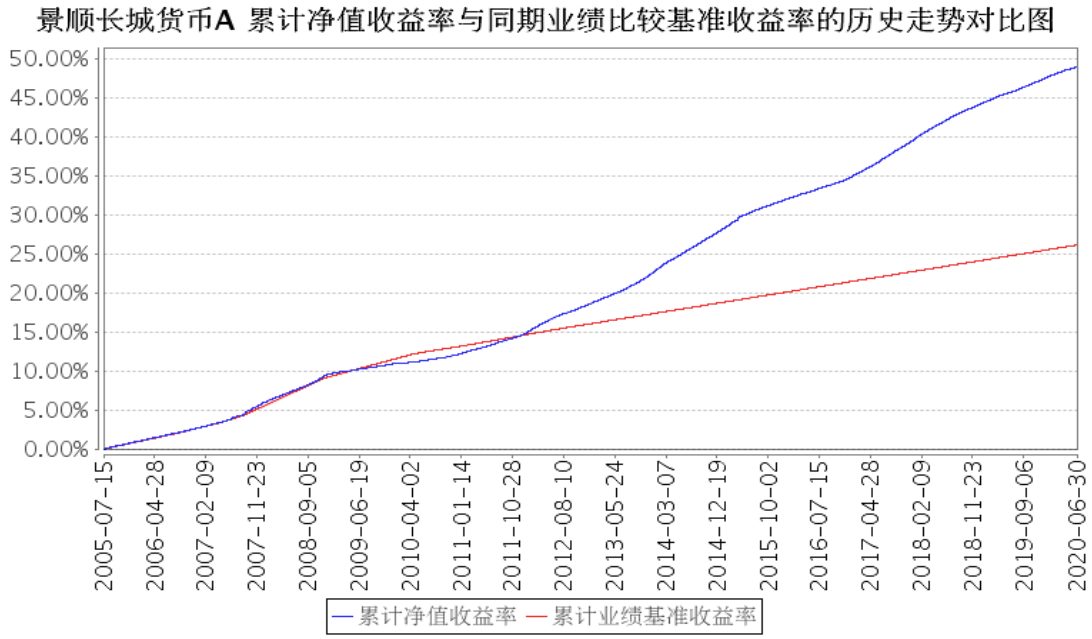
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.1355%	0.0013%	0.1107%	0.0000%	0.0248%	0.0013%
过去三个月	0.4128%	0.0013%	0.3357%	0.0000%	0.0771%	0.0013%
过去六个月	1.0111%	0.0018%	0.6713%	0.0000%	0.3398%	0.0018%
过去一年	2.1944%	0.0028%	1.3519%	0.0000%	0.8425%	0.0028%
过去三年	8.6871%	0.0033%	4.0519%	0.0000%	4.6352%	0.0033%
自基金合同生效起至今	48.9573%	0.0061%	26.1576%	0.0020%	22.7997%	0.0041%

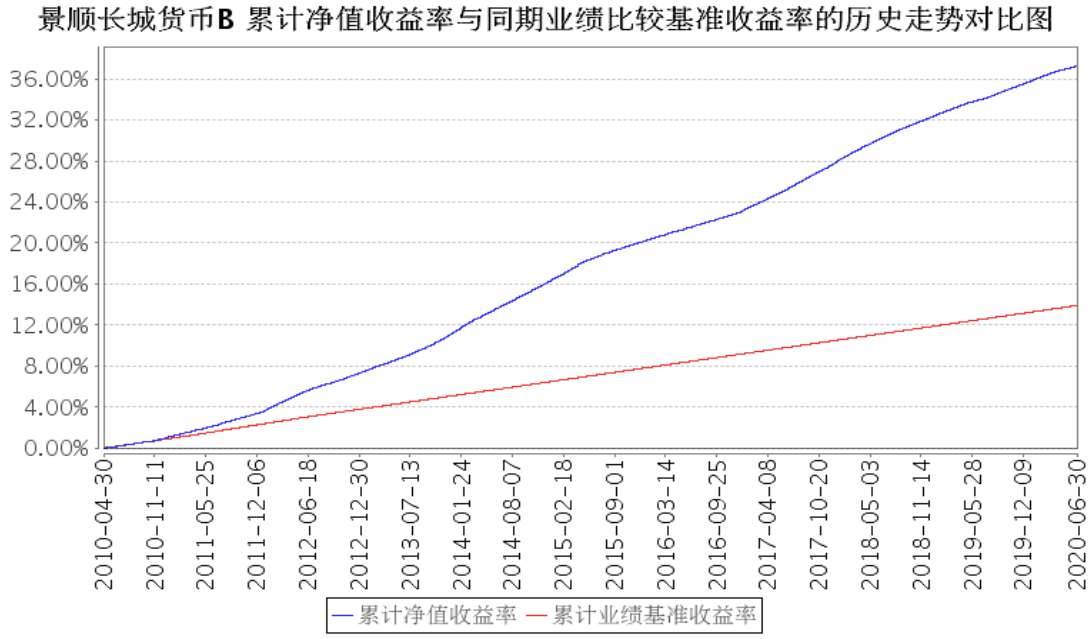
景顺长城货币 B

阶段	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
过去一个月	0.1550%	0.0013%	0.1107%	0.0000%	0.0443%	0.0013%
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%
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





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。

3.3 其他指标

无。

§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 2020 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 96 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、景顺长城品质成长混合型证券投资基金、景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、景顺长城泰申回报混合型证券投资基金、景顺长城科技创新混合型证券投资基金、景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金、景顺长城景泰裕利纯债债券型证券投资基金、景顺长城核心优选一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城创业板综指增强型证券投资基金、景顺长城成长领航混合型证券投资基金、景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金。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	-	9	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	-	6	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”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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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 18 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 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

2020 年上半年，中国经济经历了疫情停摆、政策托底以及复产复工后生产生活逐步恢复的过程。国内疫情 1 月爆发以来，中央多次召开政治局会议，政策层面积极就疫情防控作出部署，同时出台各类措施减税降费等支持中小企业，明确要求财政及货币政策加码稳增长，积极财政政策需更加积极，稳健货币政策要更加灵活适度。得益于疫情防控工作的合理实施以及逆周期调节政策的有效推进，二季度各项经济指标环比大幅改善，但经济环比修复最快的阶段正在过去，整体上看年内经济仍将呈现出一个弱复苏的格局。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，央行意图通过结构性货币政策工具、LPR 报价制度改革、规范结构性存款等方式降低银行负债成本，推动降低企业融资成本。

为应对疫情冲击，央行货币政策积极有为，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。年初以来，央行通过 3 次降准共计释放流动性 1.75 万亿，并提供了 3000 亿元疫情专项再贷款，增加了支小支农再贷款、再贴现额度 1.5 万亿元，通过注入长期流动性有效的避免了疫情影响下对实体经济造成流动性冲击。除了数量型工具外，央行年初以来累计调降政策利率达 30bp，带动 LPR 下行，同时自 2008 年来首次下调银行超额存款准备金利率从 0.72%至 0.35%，并下调再贷款、再贴现利率 0.25 个百分点，既降低了融资成本，又增强银行投放贷款的动力，有利于促进更多资金直达实体。 而财政方面，政府出台了一系列大幅度宽松举措以帮助企业缓解流动性压力。首先抗疫期间大幅减税降费，而且中央基建投资对地方转移支付资金进度较去年显著提高，广义财政扩张加快，财政融资渠道扩容，扩大地方专项债规模，发行 1 万亿抗疫特别国债。另一方面众志成城对抗疫情，国企反哺实体共渡难关，免收高速公路通行费、降低水电煤费、部分国企减免企业租金、铁路等，银行层面适度容忍中小企业还款推迟，积极发放抗疫低利率信贷等，这一系列举措均从一定程度上减轻了中小企业负担。

在货币财政政策大力支持下，我国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，隔夜加权利率的中枢从 3 月低于 1%位置快速回升至 6 月 1.9%附近，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、特别国债等缴款使得 6 月以来资金面波动频率加大，央行对于流动性的调控力度加强。

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，在春节后资金面大幅宽松的情况下，期限利差有所拉大，组合多配置长期限存款将久期保持在中长水平，同时避免负偏离。因隔夜资金价格多数情况保持低位，货币政策保持宽松不变，组合相应的提高了杠杆比率，以获得较多的杠杆收益。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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2020 年上半年，景顺长城货币 A 份额净值收益率为 1.0111%，业绩比较基准收益率为 0.6713%。

2020 年上半年，景顺长城货币 B 份额净值收益率为 1.1313%，业绩比较基准收益率为 0.6713%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前整体宏观场景已由“衰退”转向“复苏”，二季度实际 GDP 增速反弹至 3.2%，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，而房地产投资韧性十足，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。未来货币政策重心仍然是降低实体融资成本，但更多通过定向精准支持。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，公开市场逆回购重启后，中长期流动性供给在持续减少，降准预期削弱，资金面波动势必加大。而资金利率上，DR007 利率中枢预计逐步收敛至政策利率 2.2%水平，但以该利率对应的货币市场利率曲线仍然过于平坦，长端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、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，组合将增配长期限存款，逐步拉长久期并降低杠杆比率。

4.6 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及适用性的情况时，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。

4.7 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”。

4.8 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 托管人对本中期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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	2,548,653,883.38	1,713,724,136.82
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,315,173,125.51	1,712,654,940.75
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,315,173,125.51	1,712,654,940.75
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,968,614,852.93	1,135,749,703.63
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	40,492,544.33	16,323,603.06
应收股利		-	-
应收申购款		5,988,824.99	1,532,768.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,878,923,231.14	4,579,985,153.00
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020年6月30日**	**上年度末 2019年12月31日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		141,159,729.42	186,099,706.95
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		42,437.37	266,594.26
应付管理人报酬		1,322,879.38	765,647.82
应付托管费		264,575.90	153,129.57
应付销售服务费		1,280,794.72	741,603.55
应付交易费用	6.4.7.7	87,675.95	63,534.26
应交税费		75,691.64	67,671.58
应付利息		9,165.59	11,414.50
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	71,786.14	94,997.51
负债合计		144,314,736.11	188,264,300.00
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	7,734,608,495.03	4,391,720,853.00
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		7,734,608,495.03	4,391,720,853.00
负债和所有者权益总计		7,878,923,231.14	4,579,985,153.00

注： 报告截止日2020年6月30日，基金份额总额7,734,608,495.03份，其中A级基金份额净值 1.0000 元，基金份额 7,569,259,958.43 份； B 级基金份额净值 1.0000 元，基金份额165,348,536.60份。

6.2 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：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		76,526,351.08	7,419,496.27
1.利息收入		76,574,823.03	7,236,789.46
其中：存款利息收入	6.4.7.11	37,870,434.29	2,208,696.16
债券利息收入		18,168,456.63	3,756,788.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,535,932.11	1,271,304.45
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-48,471.95	182,706.81
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-48,471.95	182,706.81
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
减：二、费用		18,406,348.56	1,795,335.50
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	7,325,227.01	816,338.83
2．托管费	6.4.10.2.2	1,465,045.36	247,375.29
3．销售服务费	6.4.10.2.3	7,060,597.29	418,996.43
4．交易费用	6.4.7.18	-	-
5．利息支出		2,399,791.92	192,527.90
其中：卖出回购金融资产支出		2,399,791.92	192,527.90
6．税金及附加		8,980.34	2,496.69
7．其他费用	6.4.7.19	146,706.64	117,600.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		58,120,002.52	5,624,160.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		58,120,002.52	5,624,160.77

6.3 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30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）	4,391,720,853.00	-	4,391,720,853.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	58,120,002.52	58,120,002.52
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）	3,342,887,642.03	-	3,342,887,642.03
其中：1.基金申购款	95,151,801,187.06	-	95,151,801,187.06
2.基金赎回款	-91,808,913,545.03	-	-91,808,913,545.03
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）	-	-58,120,002.52	-58,120,002.52
五、期末所有者权益（基金净值）	7,734,608,495.03	-	7,734,608,495.03
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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）	-	5,624,160.77	5,624,160.77
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）	-150,004,907.47	-	-150,004,907.47
其中：1.基金申购款	2,267,029,100.80	-	2,267,029,100.80
2.基金赎回款	-2,417,034,008.27	-	-2,417,034,008.27
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）	-	-5,624,160.77	-5,624,160.77
五、期末所有者权益（基金净值）	467,310,898.32	-	467,310,898.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 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 8 月 20 日批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年半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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日

活期存款	2,653,883.38
定期存款	2,546,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	200,000,000.00
存款期限 3 个月至 1 年	2,346,000,000.00
存款期限 1 年以上	-
其他存款	-
合计	2,548,653,883.38

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 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	2,315,173,125.51	2,315,569,000.00	395,874.49	0.0051
	合计	2,315,173,125.51	2,315,569,000.00	395,874.49	0.0051
资产支持证券		-	-	-	-
合计		2,315,173,125.51	2,315,569,000.00	395,874.49	0.0051

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。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	2,968,614,852.93	-
合计	2,968,614,852.93	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日

应收活期存款利息	235.59
应收定期存款利息	23,050,990.77
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	14,974,769.54
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	2,466,548.43
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	40,492,544.33

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	87,675.95
合计	87,675.95

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	627.68
应付证券出借违约金	-
预提费用	71,158.46
合计	71,786.14

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城货币 A

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,250,081,343.78	4,250,081,343.78
本期申购	94,223,183,601.57	94,223,183,601.57
本期赎回（以“-”号填列）	-90,904,004,986.92	-90,904,004,986.92
-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	7,569,259,958.43	7,569,259,958.43

景顺长城货币 B

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	141,639,509.22	141,639,509.22
本期申购	928,617,585.49	928,617,585.49
本期赎回（以“-”号填列）	-904,908,558.11	-904,908,558.11
-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	165,348,536.60	165,348,536.60

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。

6.4.7.10 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	55,808,126.01	-	55,808,126.01
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	-55,808,126.01	-	-55,808,126.01
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	2,311,876.51	-	2,311,876.51
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	-2,311,876.51	-	-2,311,876.51
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	22,751.77
定期存款利息收入	37,847,682.52
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	37,870,434.29

6.4.7.12 股票投资收益

不适用。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,912,828,419.22
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,884,913,439.31
减：应收利息总额	27,963,451.86
买卖债券差价收入	-48,471.95

6.4.7.14 衍生工具收益

不适用。

6.4.7.15 股利收益

不适用。

6.4.7.16 公允价值变动收益

不适用。

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.18 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	42,267.68
信息披露费	19,890.78
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	18,600.00
银行划款手续费	65,948.18
合计	146,706.64

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,325,227.01	816,338.83
其中：支付销售机构的客户维护费	4,847,696.28	270,230.37

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,465,045.36	247,375.29

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。

6.4.10.2.3 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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	10,304.81	4,433.24	14,738.05
中国银行	40,046.29	484.84	40,531.13
长城证券	1,253.57	-	1,253.57
合计	51,604.67	4,918.08	56,522.75
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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	15,760.26	2,650.61	18,410.87
中国银行	25,123.11	503.65	25,626.76
长城证券	426.91	-	426.91
合计	41,310.28	3,154.26	44,464.54

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：

日销售服务费＝前一日对应级别基金资产净值 X 对应级别约定年费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	99,176,768.44	-	-	-	1,690,525,000.00	178,621.58
上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	279,440,988.80
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	279,440,988.80
报告期末持有的基金份额	-	-
报告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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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	2,653,883.38	22,751.77	774,280.68	6,188.62
中国银行-定期	-	676,711.15	20,000,000.00	153,833.55

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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 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
55,808,126.01	-	-	55,808,126.01	-
景顺长城货币 B				
已按再投资形式转	直接通过应付	应付利润	本期利润分配合计	备注

实收基金	赎回款转出金额	本年变动		
2,311,876.51	-	-	2,311,876.51	-

6.4.12 期末(2020 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2020 年 6 月 30 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 141,159,729.42 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
170209	17 国开 09	2020 年 7 月 1 日	100.52	1,000,000	100,518,806.58
209917	20 贴现国债 17	2020 年 7 月 1 日	99.97	460,000	45,987,346.73
合计				1,460,000	146,506,153.31

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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发行的证券，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 24.62%（上年末：32.17%）。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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 1.94%（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 48 天，平均剩余存续期为 48 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公司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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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，并按照合约规定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 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
资产							
银行存款	620,653,883.38	998,000,000.00	930,000,000.00	-	-	-	2,548,653,883.38
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	789,373,855.33	1,149,254,815.10	376,544,455.08	-	-	-	2,315,173,125.51
买入返售金融资产	2,968,614,852.93	-	-	-	-	-	2,968,614,852.93
应收利息	-	-	-	-	-	40,492,544.33	40,492,544.33
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	5,988,824.99	5,988,824.99
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,378,642,591.64	2,147,254,815.10	1,306,544,455.08	-	-	46,481,369.32	7,878,923,231.14
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	42,437.37	42,437.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,322,879.38	1,322,879.38
应付托管费	-	-	-	-	-	264,575.90	264,575.90
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	141,159,729.42	-	-	-	-	-	141,159,729.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,280,794.72	1,280,794.72
应付交易费用	-	-	-	-	-	87,675.95	87,675.95
应付利息	-	-	-	-	-	9,165.59	9,165.59
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	75,691.64	75,691.64
其他负债	-	-	-	-	-	71,786.14	71,786.14
负债总计	141,159,729.42	-	-	-	-	3,155,006.69	144,314,736.11
利率敏感度缺口	4,237,482,862.22	2,147,254,815.10	1,306,544,455.08	-	-	-	-
上年度末 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

资产							
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	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,639,050,787.37	2,161,363,798.23	761,714,195.60	-	-	17,856,371.80	4,579,985,153.00
负债							
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
负债总计	186,099,706.95	-	-	-	-	2,164,593.05	188,264,300.00
利率敏感度缺口	1,452,951,080.42	2,161,363,798.23	761,714,195.60	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 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		
分析	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 （2020 年 6 月 30 日）	上年度末 （2019 年 12 月 31 日 ）

	市场利率上升 25 个基点	-963,023.37	-801,504.80
	市场利率下降 25 个基点	964,383.58	802,994.46

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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，所面临的最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：

6.4.13.4.3.1 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）。

6.4.13.4.3.2 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）。

6.4.14 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 2020 年 6 月 30 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 2,315,173,125.51 元，无属于第一或第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第二层次 1,712,654,940.75 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 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 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。

§7 投资组合报告

7.1 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	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	其他各项资产	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。

7.2 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	5.37	
	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	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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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。

7.3.2 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	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

7.4 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。

7.5 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	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	-	-

7.6 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	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

7.7 “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%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0348%

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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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、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 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。

7.9.3 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	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

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	（户）		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	173,423	43,646.23	8,753,125.81	0.12	7,560,506,832.62	99.88
景顺长城货币 B	15	11,023,235.77	91,057,092.41	55.07	74,291,444.19	44.93
合计	173,438	44,595.81	99,810,218.22	1.29	7,634,798,276.81	98.71

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）。

8.2 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	26,917,537.32	0.35
2	银行类机构	26,082,150.68	0.34
3	个人	17,228,550.94	0.22
4	其他机构	15,045,850.84	0.19
5	个人	13,717,406.09	0.18
6	券商类机构	10,899,879.47	0.14
7	基金类机构	10,224,508.01	0.13
8	其他机构	10,096,606.42	0.13
9	个人	10,016,246.78	0.13
10	个人	10,000,573.19	0.13

8.3 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	262,758.32	0.00
	景顺长城货币 B	-	-
	合计	262,758.32	0.00

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）。

8.4 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。

§9 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	4,250,081,343.78	141,639,509.22
本报告期基金总申购份额	94,223,183,601.57	928,617,585.49
减：本报告期基金总赎回份额	90,904,004,986.92	904,908,558.11
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	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。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 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。

3、本基金管理人于 2020 年 5 月 28 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，同意吴建军先生辞去本公司首席信息官一职，聘任张明先生担任本公司首席信息官。

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：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
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	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
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：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。

10.7.2 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	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 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。

10.9 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	景顺长城货币市场证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 21 日

2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2019年第4季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年1月21日
3	景顺长城基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年1月22日
4	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年1月30日
5	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年1月31日
6	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年2月3日
7	景顺长城基金管理有限公司及全资子公司投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年2月6日
8	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年3月6日
9	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	中国证监会指定报刊及网站	2020年3月19日
10	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年3月20日
11	景顺长城基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金2019年年度报告的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年3月30日
12	景顺长城基金管理有限公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年4月7日
13	景顺长城基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年4月8日
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2019年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年4月20日
15	景顺长城货币市场证券投资基金2019年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020年4月20日
16	景顺长城货币市场证券投资基金2020年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020年4月22日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2020年第1季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年4月22日
18	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统农业银行渠道暂停支付的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年4月29日
19	景顺长城基金管理有限公司关于直销	中国证监会指定报刊及	2020年4月30日

	网上交易系统农业银行渠道恢复支付的公告	网站	
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在招商银行开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 14 日
21	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	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 15 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行股份有限公司定期定额投资最低金额限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 20 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员（首席信息官）变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 28 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京汇成基金销售有限公司基金申购及转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 6 月 1 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 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 8 月 24 日