

# 景顺长城货币市场证券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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 10 月 27 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 10 月 26 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 07 月 01 日起至 2020 年 09 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	12,828,167,052.98 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	12,360,545,191.61 份	467,621,861.37 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7月1日-2020年9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	49,280,015.22	2,332,942.44
2. 本期利润	49,280,015.22	2,332,942.44
3. 期末基金资产净值	12,360,545,191.61	467,621,861.37

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	0.4837%	0.0007%	0.3393%	0.0000%	0.1444%	0.0007%
过去六个月	0.8985%	0.0011%	0.6750%	0.0000%	0.2235%	0.0011%
过去一年	2.0953%	0.0016%	1.3509%	0.0000%	0.7444%	0.0016%
过去三年	8.1643%	0.0031%	4.0509%	0.0000%	4.1134%	0.0031%
过去五年	14.1173%	0.0034%	6.7509%	0.0000%	7.3664%	0.0034%
自基金合同生效起至今	49.6779%	0.0061%	26.4969%	0.0019%	23.1810%	0.0042%

景顺长城货币 B

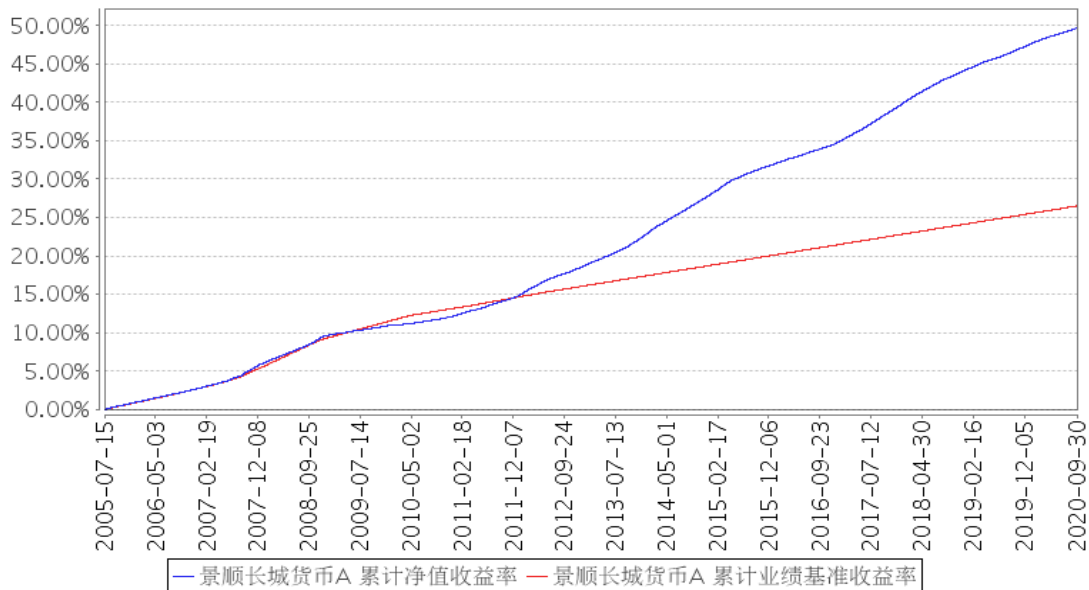
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.5441%	0.0007%	0.3393%	0.0000%	0.2048%	0.0007%
过去六个月	1.0192%	0.0011%	0.6750%	0.0000%	0.3442%	0.0011%
过去一年	2.3399%	0.0016%	1.3509%	0.0000%	0.9890%	0.0016%
过去三年	8.9422%	0.0031%	4.0509%	0.0000%	4.8913%	0.0031%
过去五年	15.4899%	0.0034%	6.7509%	0.0000%	8.7390%	0.0034%
自基金合同生效起至今	37.9981%	0.0056%	14.2480%	0.0001%	23.7501%	0.0055%

注：1、本基金自 2010 年 4 月 30 日起实行基金份额分级。

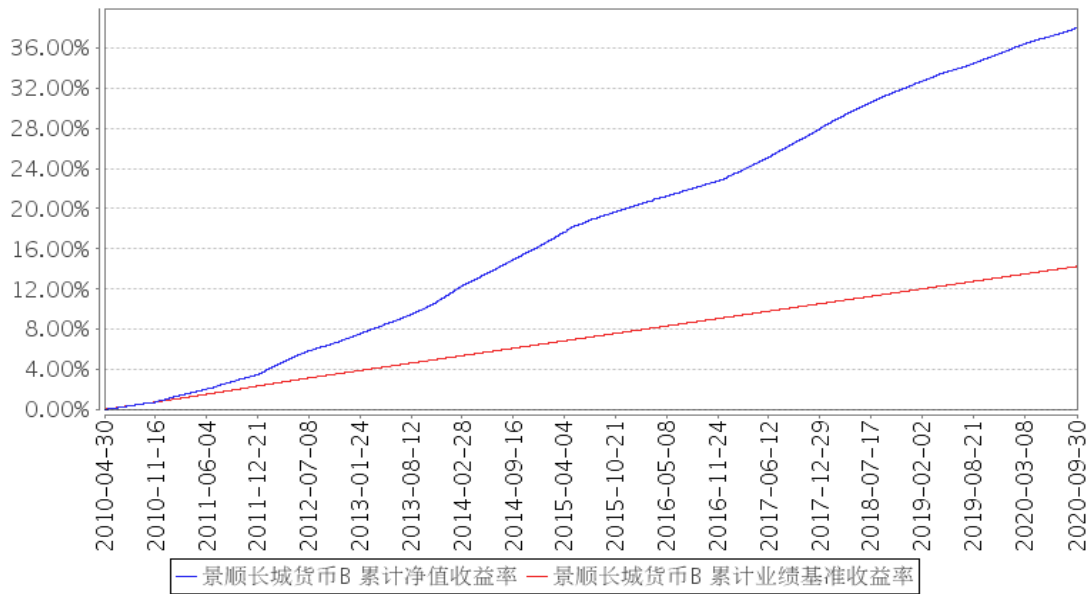
2、自 2019 年 6 月 17 日起本基金的收益分配方式由每日分配，按月结转份额改为每日分配，按日结转份额。

### 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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城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 8 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

从宏观经济走势情况来看，疫情之后积极推动复工复产导致二季度经济增速出现明显反弹，虽然目前环比、同比仍在修复趋势之中，而三季度开始环比修复的幅度已经开始逐步放缓。我们对于经济整体的判断仍是弱复苏格局不变，7 月份宏观经济数据受到洪水高温的影响大多不达预期，但随着 8 月洪水消退，整体经济表现基本符合市场的预判，特别是 8 月生产数据超出市场预期，背后反映的就是洪水消退以及内需逐步恢复的影响，预计三季度实际 GDP 增速有望回到 4-5% 的区间内，较二季度进一步提升。需求端，投资方面房地产投资的表现依然最强，8 月制造业投资当月同比受低基数影响转正 5%，但 8 月份基建投资的反弹力度出现减弱，可能存在发债资金淤

积的问题；8月消费增速转正，但恢复速度仍比较慢；传统外需继续修复推动出口持续超预期。通胀方面，CPI 同比受到猪价的拖累趋于下行，而 PPI 同比目前已缓慢修复至-2%。

三季度以来货币政策延续前期节奏，从疫情对冲模式继续收敛回归常态化，至8月政策调整基本结束，货币政策进入观察期。对应短端资金利率持续向上后至8月达到合意水平，DR007 基本围绕公开市场7天逆回购利率2.2%的位置上下波动。而资金面上由于银行超储率偏低，三季度整体波动明显加大，资金利率在某些时点飙升。具体来看，7月政策整体仍处于收敛过程中，当月到期MLF及TMLF央行缩量2977亿，且从短端利率上看月平均DR007相比6月继续上行至2.1%。但从7月底开始央行维稳迹象初步显现，操作上削峰填谷平抑了资金面波动，且7月底全市场隔夜加权利率稳在1.8%左右位置。维稳态度在接下来8、9月中旬MLF续作上得到验证，8月及9月MLF到期央行续作分别净投放中期流动性1500亿及4000亿，9月底央行也通过提前投放14天公开市场维稳季末时点流动性。然而虽然央行态度上转向温和，但三季度持续的国债地方债缴款使得银行的超储率处于历史偏低水平，因此在月度中旬缴税后资金面均出现不同程度的紧张。资金面波动加大，前期资金空转套利现象减少，银行间质押式回购成交量从前期高点近5.5万亿回落至4万亿左右。

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，季度内市场对于央行货币政策持谨慎态度，在各期限资产收益率逐步上行的过程中，组合维持中性久期。在8月中旬之后，考虑到市场收益率与政策利率的比价较为合理，同时期限利差处于较高水平，组合陆续配置跨年资产，逐步提高久期至9月中下旬。因配置上多以存款为主，对组合偏离度影响有限。考虑到银行超储率处于较低水平，资金面波动加大，组合灵活调整杠杆比例，在政府债集中缴款、财政缴税以及月末季末时点上，将杠杆率控制在较低水平。

宏观场景处于“复苏”阶段的判断不变，预计今年四季度实际GDP增速将进一步向潜在增速靠拢，预计有望达到5-6%的水平，四季度的不确定性在于基建投资增速是否能够如期反弹。政策方面建议关注两点变化：一是8月调查失业率已降至5.6%，完成全年6%目标问题不大；二是8月宏观杠杆率继续抬升3%。以上两点均指向不应对后续总量政策有过多期待，综合考虑经济现状以及价格、盈利修复的节奏，明年上半年政策退出的风险较大，信用周期可能由“宽信用”向“紧信用”转化。

四季度超储率不会进一步下滑，但资金面波动仍将较大。受跨年因素影响，预计曲线形态从陡峭逐步趋于平坦。四季度，影响前期市场资金面的因素预期将有所缓解，年内资产价格保持中性水平。首先政府债券发行高峰期将于10月底前结束，而随着财政投放的陆续落地，对银行长期负债将有所帮助，超储率也不会进一步下降；其次，虽然银行结构性存款压降的压力仍存，但结

构性存款的降低只是加大了资金面的摩擦，对流动性总量影响不大，经历了一个季度的调整，这种资金的摩擦影响逐步减弱，从而也有利于资产收益在四季度的企稳；最后，考虑到央行货币政策的态度仍较为稳健，从 9 月份的操作来看，年内不至于收紧。综上所述，我们判断年内的资金面仍将维持中性水平，市场收益率仍将围绕公开市场（OMO）以及中期借贷便利（MLF）所代表的政策利率波动，但四季度影响资金面以及资产价格的因素较多，所以仍需对时点冲击、年末指标、监管新规等影响因素给予足够重视，在超储率偏低的背景下，资金面波动仍将较大。对于跨年资产来说，市场对明年的经济形势相对乐观，央行也更有理由不会放松货币政策，市场对于半年以上的资产收益相对谨慎，虽然 MLF 有可能延续超量续作，但 9 个月、1 年期的 CD 收益率仍将保持在较高水平，下行空间有限。对于 3 个月 CD 而言，四季度已经跨年，预计收益率将从当前水平逐步走高，考虑到年末指标因素，银行在 11 月之后的发行 3 个月 CD 的动力更强，若资金面不配合的话，甚至有可能与长端收益倒挂。

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。得益于组合负债端相对稳定，在期限利差合理情况下，组合仍将维持中长久期，配置上仍以跨年存款存单为主，并适量配置高等级信用债，以控制组合年末偏离度处于较低水平。同时组合仍将灵活调整杠杆比例，合理安排资产到期，在关键时点上控制好杠杆水平。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2020 年 3 季度，景顺长城货币 A 类净值收益率为 0.4837%，业绩比较基准收益率为 0.3393%。

2020 年 3 季度，景顺长城货币 B 类净值收益率为 0.5441%，业绩比较基准收益率为 0.3393%。

#### 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	3,077,729,183.86	23.98
	其中：债券	3,077,729,183.86	23.98
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,760,556,980.83	21.51
	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	6,932,322,255.48	54.01
4	其他资产	63,526,405.95	0.49
5	合计	12,834,134,826.12	100.00



注：银行存款和结算备付金合计中包含定期存款 6,930,000,000.00 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	2.07	
	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	-	-
	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	80
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	80
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

### 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	32.21	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天 (含) —60 天	12.24	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天 (含) —90 天	14.41	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天 (含) —120 天	15.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天 (含) —397 天 (含)	24.94	-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计	99.55	-

#### 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	249,287,708.81	1.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	571,699,506.89	4.46
	其中：政策性金融债	410,586,031.00	3.20
4	企业债券	30,143,792.44	0.23
5	企业短期融资券	710,225,676.92	5.54
6	中期票据	120,620,613.47	0.94
7	同业存单	1,395,751,885.33	10.88
8	其他	-	-
9	合计	3,077,729,183.86	23.99
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	160206	16 国开 06	2,000,000	200,295,408.37	1.56
2	112010262	20 兴业银行 CD262	1,500,000	149,843,699.87	1.17
3	041900430	19 国电 CP003	1,100,000	110,487,831.71	0.86
4	012000820	20 国电 SCP001	1,000,000	100,023,723.79	0.78
5	012000968	20 京基投 SCP001	1,000,000	100,018,769.35	0.78
6	112013053	20 浙商银行 CD053	1,000,000	99,899,682.25	0.78
7	012002691	20 苏交通 SCP018	1,000,000	99,893,147.85	0.78
8	112003053	20 农业银行 CD053	1,000,000	99,870,353.59	0.78
9	111905160	19 建设银行 CD160	1,000,000	99,849,659.78	0.78
10	112017158	20 光大银行 CD158	1,000,000	99,805,520.84	0.78

#### 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	0.0156%
报告期内偏离度的最低值	-0.0077%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0039%

## 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、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 12 月 27 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）22 号）。其用于风险缓释的保证金管理存在漏洞、国别风险管理不完善，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项的规定和相关内控管理和业务审慎经营规则，被处以罚款人民币 80 万元。

2020 年 4 月 20 日，建设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》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定，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）8 号），被处以罚款人民币 230 万元。

2020 年 7 月 13 日，建设银行因内控管理不到位、支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件等多项问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》的相关规定，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）32 号），被处以罚款人民币 3920 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进行了投资。

2、兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码：601166）于 2020 年 8 月 31 日收到中国银保监会福建监管局出具的行政处罚决定书（闽银保监罚决字（2020）24 号）。其因同

业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权等问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》的相关规定，被处以没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元。

2020 年 8 月 21 日，兴业银行资金营运中心因黄金租赁业务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》，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〔2020〕18 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兴业银行进行了投资。

3、浙商银行股份有限公司（以下简称“浙商银行”，股票代码：601916）于 2019 年 12 月 31 日收到中国人民银行杭州市中心支行出具的行政处罚决定书（杭银处罚字〔2019〕43 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及交易记录、未按规定进行可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易的问题，被处以罚款合计人民币 1010 万元。

2020 年 7 月 13 日，浙商银行因关联交易未经关联交易委员会审批、未严格执行关键岗位轮岗制度等多项问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》的相关规定，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〕16 号），被处以罚款人民币 10120 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浙商银行进行了投资。

4、中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”，股票代码：601288、1288.HK）于 2020 年 7 月 13 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〔2020〕36 号）。其因向关系人发放信用贷款、批量处置不良资产未公告等多项问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》的相关规定，被处以没收违法所得 55.3 万元、罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元。

2020 年 4 月 22 日，农业银行因“两会一层”境外机构管理履职不到位、国别风险管理不满足监管要求、信贷资金被挪用作保证金、未将集团成员纳入集团客户统一授信管理等问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条和相关内控管理、审慎经营规定，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〕11 号），被处以罚款合计 200 万元。

2020 年 4 月 22 日，农业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》第四十七条和相关内控管理、审慎经营

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〕12号），被处以罚款合计 230 万元。

2020 年 3 月 9 日，农业银行因违反审慎经营规则、可回溯制度执行不到位等问题，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〔2020〕3号），被处以 50 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农业银行进行了投资。

5、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进行了投资。

6、其余五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	57,779,095.20
4	应收申购款	5,747,255.55
5	其他应收款	55.20
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	63,526,405.95

**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	7,569,259,958.43	165,348,536.60
报告期期间基金总申购份额	91,075,066,417.73	865,616,728.61
报告期期间基金总赎回份额	86,283,781,184.55	563,343,403.84
报告期期末基金份额总额	12,360,545,191.61	467,621,861.37

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	2020-07-03	10,000,000.00	10,000,000.00	-
2	申赎	2020-07-06	10,000,000.00	10,000,000.00	-
3	红利再投	2020-07-06	1,622.15	1,622.15	-
4	红利再投	2020-07-07	1,073.82	1,073.82	-
5	红利再投	2020-07-08	1,065.22	1,065.22	-
6	红利再投	2020-07-09	1,043.77	1,043.77	-
7	申赎	2020-07-10	9,000,000.00	9,000,000.00	-
8	红利再投	2020-07-10	1,042.98	1,042.98	-
9	申赎	2020-07-13	10,000,000.00	10,000,000.00	-
10	红利再投	2020-07-13	5,428.44	5,428.44	-
11	申赎	2020-07-14	10,000,000.00	10,000,000.00	-
12	红利再投	2020-07-14	2,050.61	2,050.61	-
13	申赎	2020-07-15	10,000,000.00	10,000,000.00	-
14	红利再投	2020-07-15	2,559.15	2,559.15	-
15	申赎	2020-07-16	10,000,000.00	10,000,000.00	-
16	红利再投	2020-07-16	3,063.85	3,063.85	-

17	申赎	2020-07-17	10,000,000.00	10,000,000.00	-
18	红利再投	2020-07-17	3,613.59	3,613.59	-
19	申赎	2020-07-20	10,000,000.00	10,000,000.00	-
20	红利再投	2020-07-20	14,340.50	14,340.50	-
21	申赎	2020-07-21	10,000,000.00	10,000,000.00	-
22	红利再投	2020-07-21	4,787.29	4,787.29	-
23	申赎	2020-07-22	10,000,000.00	10,000,000.00	-
24	红利再投	2020-07-22	5,235.15	5,235.15	-
25	申赎	2020-07-23	10,000,000.00	10,000,000.00	-
26	红利再投	2020-07-23	5,757.20	5,757.20	-
27	申赎	2020-07-24	10,000,000.00	10,000,000.00	-
28	红利再投	2020-07-24	6,318.48	6,318.48	-
29	申赎	2020-07-27	10,000,000.00	10,000,000.00	-
30	红利再投	2020-07-27	20,379.74	20,379.74	-
31	红利再投	2020-07-28	8,576.80	8,576.80	-
32	红利再投	2020-07-29	7,521.14	7,521.14	-
33	申赎	2020-07-30	9,000,000.00	-9,000,000.00	-
34	红利再投	2020-07-30	7,543.35	7,543.35	-
35	红利再投	2020-07-31	7,112.31	7,112.31	-
36	申赎	2020-08-03	5,000,000.00	-5,000,000.00	-
37	红利再投	2020-08-03	21,507.15	21,507.15	-
38	红利再投	2020-08-04	6,831.98	6,831.98	-
39	申赎	2020-08-05	10,000,000.00	10,000,000.00	-
40	红利再投	2020-08-05	6,785.89	6,785.89	-
41	申赎	2020-08-06	10,000,000.00	10,000,000.00	-
42	红利再投	2020-08-06	7,322.00	7,322.00	-
43	红利再投	2020-08-07	7,814.31	7,814.31	-
44	红利再投	2020-08-10	25,242.89	25,242.89	-

45	申赎	2020-08-11	10,000,000.00	10,000,000.00	-
46	红利再投	2020-08-11	8,010.88	8,010.88	-
47	申赎	2020-08-12	10,000,000.00	10,000,000.00	-
48	红利再投	2020-08-12	8,574.21	8,574.21	-
49	申赎	2020-08-13	10,000,000.00	10,000,000.00	-
50	红利再投	2020-08-13	9,253.03	9,253.03	-
51	申赎	2020-08-14	10,000,000.00	10,000,000.00	-
52	红利再投	2020-08-14	9,890.87	9,890.87	-
53	申赎	2020-08-17	10,000,000.00	10,000,000.00	-
54	红利再投	2020-08-17	31,134.13	31,134.13	-
55	红利再投	2020-08-18	13,123.43	13,123.43	-
56	申赎	2020-08-19	2,000,000.00	-2,000,000.00	-
57	红利再投	2020-08-19	11,160.84	11,160.84	-
58	红利再投	2020-08-20	10,807.25	10,807.25	-
59	申赎	2020-08-21	3,000,000.00	-3,000,000.00	-
60	红利再投	2020-08-21	10,818.18	10,818.18	-
61	红利再投	2020-08-24	31,888.18	31,888.18	-
62	红利再投	2020-08-25	15,327.98	15,327.98	-
63	红利再投	2020-08-26	10,976.18	10,976.18	-
64	红利再投	2020-08-27	11,169.02	11,169.02	-
65	申赎	2020-08-28	9,000,000.00	-9,000,000.00	-
66	红利再投	2020-08-28	11,049.47	11,049.47	-
67	红利再投	2020-08-31	31,600.62	31,600.62	-
68	红利再投	2020-09-01	12,507.11	12,507.11	-
69	红利再投	2020-09-02	10,547.91	10,547.91	-
70	申赎	2020-09-03	10,000,000.00	10,000,000.00	-
71	红利再投	2020-09-03	10,507.43	10,507.43	-
72	申赎	2020-09-04	10,000,000.00	10,000,000.00	-



73	红利再投	2020-09-04	11,125.19	11,125.19	-
74	申赎	2020-09-07	5,000,000.00	5,000,000.00	-
75	红利再投	2020-09-07	36,750.03	36,750.03	-
76	红利再投	2020-09-08	12,014.79	12,014.79	-
77	红利再投	2020-09-09	12,128.27	12,128.27	-
78	红利再投	2020-09-10	15,917.27	15,917.27	-
79	红利再投	2020-09-11	12,445.28	12,445.28	-
80	红利再投	2020-09-14	39,089.67	39,089.67	-
81	红利再投	2020-09-15	15,347.99	15,347.99	-
82	申赎	2020-09-16	10,000,000.00	10,000,000.00	-
83	红利再投	2020-09-16	12,293.15	12,293.15	-
84	申赎	2020-09-17	10,000,000.00	10,000,000.00	-
85	红利再投	2020-09-17	16,556.37	16,556.37	-
86	申赎	2020-09-18	26,000,000.00	-26,000,000.00	-
87	红利再投	2020-09-18	13,472.14	13,472.14	-
88	红利再投	2020-09-21	36,413.66	36,413.66	-
89	红利再投	2020-09-22	12,293.83	12,293.83	-
90	红利再投	2020-09-23	12,898.32	12,898.32	-
91	红利再投	2020-09-24	15,146.66	15,146.66	-
92	申赎	2020-09-25	4,000,000.00	-4,000,000.00	-
93	红利再投	2020-09-25	12,809.15	12,809.15	-
94	申赎	2020-09-28	4,000,000.00	-4,000,000.00	-
95	红利再投	2020-09-28	39,563.14	39,563.14	-
96	红利再投	2020-09-29	12,531.98	12,531.98	-
97	红利再投	2020-09-30	12,341.64	12,341.64	-
合计			316,795,125.01	192,795,125.01	

注：基金管理人本期运用固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 10 月 27 日