

景顺长城货币市场证券投资基金 2020 年第 4 季度报告

2020 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

报告送出日期：2021 年 1 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 2021 年 01 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 10 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 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	13,717,675,305.32 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	13,326,357,579.26 份	391,317,726.06 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 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日）	
	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B
1. 本期已实现收益	76,222,741.98	2,702,879.45
2. 本期利润	76,222,741.98	2,702,879.45
3. 期末基金资产净值	13,326,357,579.26	391,317,726.06

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	0.5961%	0.0010%	0.3393%	0.0000%	0.2568%	0.0010%
过去六个月	1.0827%	0.0011%	0.6787%	0.0000%	0.4040%	0.0011%
过去一年	2.1048%	0.0015%	1.3500%	0.0000%	0.7548%	0.0015%
过去三年	7.7516%	0.0028%	4.0500%	0.0000%	3.7016%	0.0028%
过去五年	14.1425%	0.0033%	6.7500%	0.0000%	7.3925%	0.0033%
自基金合同生效起至今	50.5702%	0.0061%	26.8363%	0.0019%	23.7339%	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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

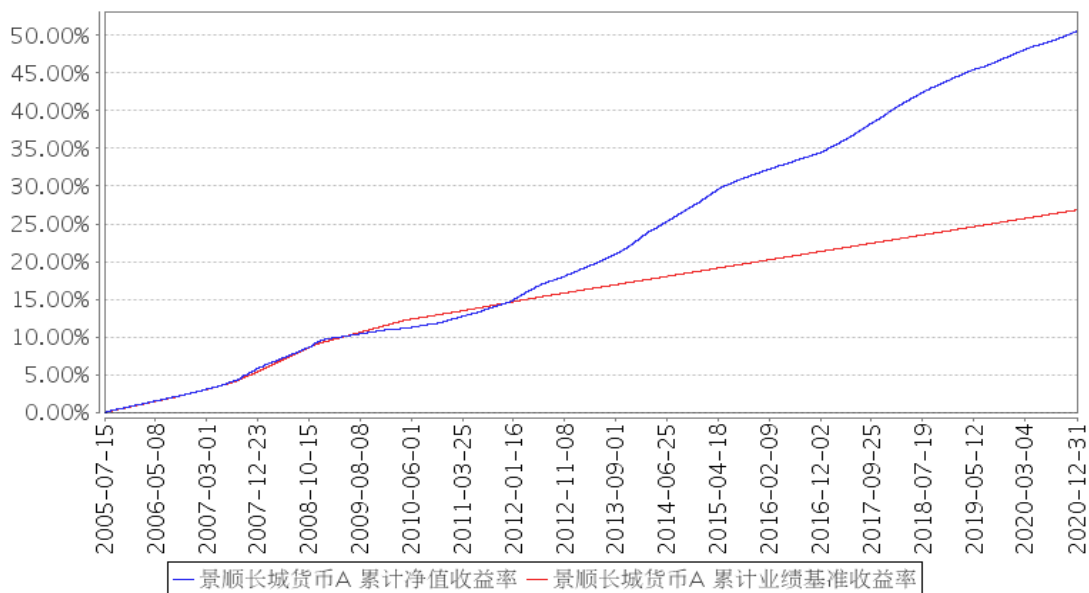
				④		
过去三个月	0.6568%	0.0010%	0.3393%	0.0000%	0.3175%	0.0010%
过去六个月	1.2044%	0.0011%	0.6787%	0.0000%	0.5257%	0.0011%
过去一年	2.3493%	0.0015%	1.3500%	0.0000%	0.9993%	0.0015%
过去三年	8.5268%	0.0028%	4.0500%	0.0000%	4.4768%	0.0028%
过去五年	15.5150%	0.0033%	6.7500%	0.0000%	8.7650%	0.0033%
自基金合同生效起至今	38.9045%	0.0055%	14.5873%	0.0001%	24.3172%	0.0054%

注：1、本基金自 2010 年 4 月 30 日起实行份额分级；

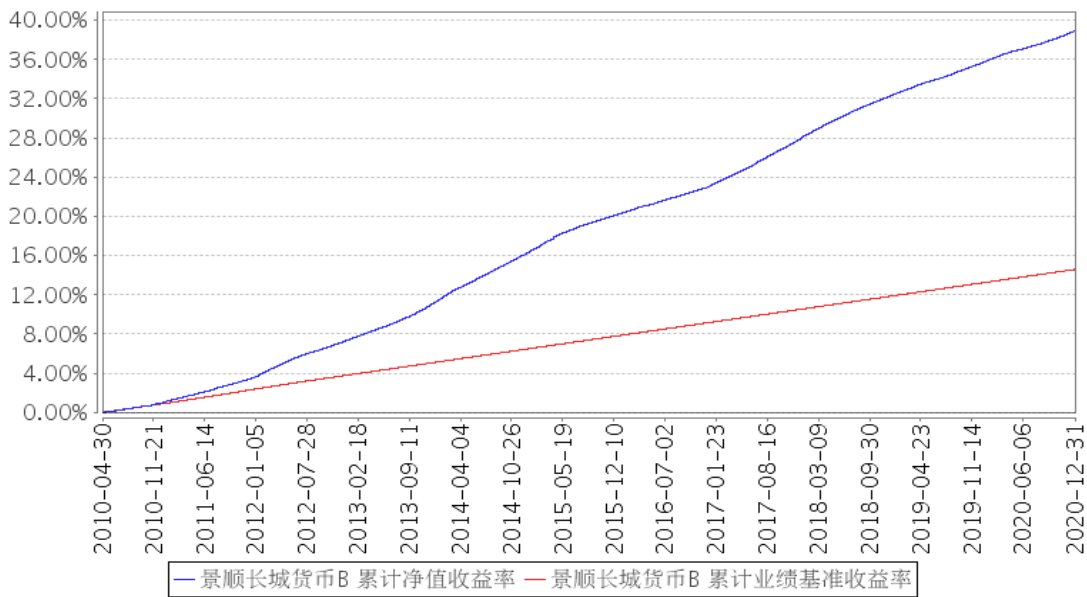
2、自 2019 年 6 月 17 日起本基金的收益分配方式由每日分配，按月结转份额改为每日分配，按日结转份额。

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 1 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

货币政策自二季度以来回归常态后，四季度整体保持中性稳健，但政策重心区别前两个季度，更多体现在总量维稳、防止发生系统性风险上。政策呵护意图明显，同时通过数量型和价格型两方面调控引导市场。

首先数量型调控方面，可以看到中长端流动性供给显著增加，以缓解超储率偏低、银行结构性存款压降过程中的长端负债压力。10、11、12 月份 MLF 分别超额续作 4000 亿、4000 亿和 3500 亿，大幅高于三季度水平。尤其 11 月底额外开展一笔 2000 亿 MLF 操作，表明央行在永煤事件发生后对于信用风险事件的维稳态度，以防止信用收缩过快及年底流动性分层风险。在公开市场逆

回购方面，区别于以往年份，12 月份在资金面较为宽松的情况下仍然持续净投放至最后一个交易日。在价格型调控方面，以永煤事件为分水岭，10 月至 11 月中旬银行间平均隔夜加权利率为 2.17%，相比三季度整体大幅走高。永煤事件后隔夜加权利率逐步下行，12 月整体处于历史较低水平，当月银行间平均隔夜加权利率为 1.14%，大幅低于 11 月份的 1.93%。

对应到货币市场方面，四季度资金面波动相对加大，货币市场利率中枢在季节性因素、结构性存款压降、信用事件后引发赎回抛盘等因素下持续攀升，之后在 11 月底央行额外操作 2000 亿 MLF 后，3 个月的同业存单收益率从年内高点 3.3% 的位置一路下行至年底 2.75%，而 1 年期品种的收益率也从高点的 3.4% 下行至年底的 3.0% 附近，货币市场收益率曲线陡峭下行。

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，季度内央行货币政策有所转变，各期限资产收益率先上后下，组合在收益率走高过程中逐步拉长久期，收益率下行后又逐步自然回落。拉长久期过程中，因配置上多以存款为主，对组合偏离度影响有限。12 月后资金面转松，组合提高了杠杆比例，并增加配置 6 个月以内到期的同业存单占比以及回购比例，增厚组合收益。因组合提前布局资产到期，“双 11”、“双 12”以及年末时点上流动性冲击对组合影响不大，均平稳度过。

预计 2021 年全年 GDP 有望实现 9% 左右的增长，受基数影响各季度 GDP 增速大体呈现出前高后低的走势，对上半年的经济高增长基本已形成市场共识，而下半年的情况目前仍有不少不确定性以及争议，争议焦点在于出口以及制造业投资景气度的可持续性、基建房地产投资回落幅度，前者的节奏取决于海外疫情的演化，后者取决于国内的政策导向。

信用周期一般领先于经济周期，我们判断目前的宏观场景正处于信用周期的顶部位置，2021 年 3 月份开始社融增速将明显下降，形成“紧信用”环境，而货币政策大体将维持现状、保持合理适度。第三季度的货币政策报告以及中央经济工作会议上对于货币政策的提法，包括“精准有效，不转急弯”，“稳健的货币政策灵活精准、合理适度”，“保持宏观杠杆率基本稳定”。货币政策的多目标制决定了不同阶段货币政策的侧重点也是不同的，比如 2020 年上半年是对冲疫情冲击的宽松，下半年则是防止空转套利的趋紧。随着国内疫情得到较好的控制，供给和需求端都在逐步修复，2021 年货币政策的重心应该是防风险与稳杠杆的平衡。防风险角度要求货币政策适度放松，比如前期应对永煤的违约事件；在稳杠杆方面，2021 年在政府债发行减少、经济增速大幅提高的前提下，不需要主动压缩合理的信贷需求来稳定宏观杠杆率。在通胀压力不大的前提下，货币政策也不至于明显收紧。因此，对于 2021 年初的货币政策还是维持一个中性偏乐观的判断。

跨年资金面受年末财政投放效应影响，预计仍将维持一段时间的宽松，但随着公开市场操作的陆续到期，将逐步有所收敛，预计短端收益率也将从低位反弹，使得市场利率围绕政策利率

中枢波动。但预计反弹空间有限，一来信用风险对融资冲击尚未解决，二来一月份为缴税大月，随后为春节长假，3月将召开两会以及面临季末时点，多方面因素均要求央行维持一个稳定偏宽松的货币环境，短期来看，无大幅收紧的可能。所以对于短期缺口，预计央行仍将以公开市场形式加以对冲，而对于中长期缺口，MLF 超额续作是必要选择，同时不排除春节期间降准的可能性。随着隔夜资金价格的逐步回升，预计 3 个月 CD 收益率也将随之上行，维持 MLF 操作利率为 1 年期 CD 下限的判断，预计跨年后 1 年期 CD 收益率将与 MLF 的利差逐步拉大，整体曲线将平坦上行。

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，细致管理组合流动性。短期内将以回购交易为主，通过提高杠杆水平增厚组合收益。随着收益率曲线逐步上行，在期限利差合理情况下，组合仍将维持中长久期，配置上以半年内存款存单为主，并适量配置高等级信用债。同时组合仍将合理安排资产到期，重点关注春节期限取现需求对组合流动性的影响，控制好杠杆水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2020 年 4 季度，景顺长城货币 A 类净值收益率为 0.5961%，业绩比较基准收益率为 0.3393%。

2020 年 4 季度，景顺长城货币 B 类净值收益率为 0.6568%，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	3,551,841,995.85	24.77
	其中：债券	3,551,841,995.85	24.77
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	3,561,862,782.80	24.84
	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	7,132,938,276.83	49.74
4	其他资产	94,796,244.81	0.66
5	合计	14,341,439,300.29	100.00

注：银行存款和结算备付金合计中包含定期存款 7,130,000,000.00 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	3.94	
	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	614,669,292.66	4.48
	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	76
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	69

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	44.14	4.48
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天 (含) — 60 天	11.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天 (含) — 90 天	9.83	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天 (含) — 120 天	11.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天 (含) — 397 天 (含)	26.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	103.86	4.48

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	59,712,219.95	0.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	750,547,331.03	5.47
	其中：政策性金融债	640,016,873.81	4.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,148,835,581.51	8.37
6	中期票据	90,599,024.51	0.66
7	同业存单	1,502,147,838.85	10.95
8	其他	-	-
9	合计	3,551,841,995.85	25.89
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	012003179	20 中电投 SCP022	2,200,000	219,867,635.15	1.60
2	112009375	20 浦发银行 CD375	2,000,000	198,793,378.46	1.45
3	112016106	20 上海银行 CD106	2,000,000	198,016,364.66	1.44
4	112013027	20 浙商银行 CD027	2,000,000	197,189,534.24	1.44
5	112011274	20 平安银行 CD274	2,000,000	196,463,890.26	1.43
6	200211	20 国开 11	1,400,000	139,109,697.83	1.01
7	200306	20 进出 06	1,300,000	129,618,259.99	0.94
8	180208	18 国开 08	1,100,000	110,382,872.63	0.80
9	012001573	20 苏国信 SCP011	1,000,000	100,052,663.83	0.73
10	012003187	20 浙能源 SCP013	1,000,000	100,024,677.96	0.73

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	0.0503%
报告期内偏离度的最低值	0.0100%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0206%

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，基金份额净值均为 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、平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”，股票代码：000001）于 2020 年 1 月 20 日收到中国银保监会深圳监管局出具的行政处罚决定书（深银保监罚决字〔2020〕7 号）。其因汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成、代理保险销售的人员为非商业银行人员等问题，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 720 万元罚款。

平安银行于 2020 年 10 月 16 日收到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局出具的行政处罚决定书（甬银保监罚决字〔2020〕66 号）。其因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等问题，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 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 20 平安银行 CD274 进行了投资。

2、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 2020 年 8 月 10 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〔2020〕12 号）。其因 2013 年至 2018 年存在未按专营部门制规定开展同业业务等多项违法违规事实，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）项等规定，被处以 2100 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 20 浦发银行 CD375 进行了投资。

3、2020 年 7 月 13 日，浙商银行股份有限公司（以下简称“浙商银行”，股票代码：601916）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 20 浙商银行 CD027 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 2020 年 11 月 18 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（2020）25 号）。其因 2014 年至 2018 年绩效考评管理严重违反审慎经营规则、2018 年未按规定延期支付 2017 年度绩效薪酬等问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、《中国银行业监督管理委员会关于印发银行业金融机构绩效考评监管指引的通知》（银监发〔2012〕34 号）第三十二条、《商业银行稳健薪酬监管指引》（银监发〔2010〕14 号）第二十五条的相关规定，被处以罚款人民币 80 万元。

2020 年 8 月 14 日，上海银行违规向资本金不足、“四证”不全的房地产项目发放贷款，以其他贷款科目发放房地产开发贷款、并购贷款管理严重违反审慎经营规则、经营性物业贷款管理严重违反审慎经营规则等原因，违反了《中华人民共和国商业银行法》第七十三条、第七十四条、第八十条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十七条等规定，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（2020）14 号），被处以没收违法所得 27.155092 万元，罚款 1625 万元，罚没合计 1652.155092 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 20 上海银行 CD106 进行了投资。

5、国家开发银行于 2020 年 12 月 25 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〕67 号）。其因为违规的政府购买服务项目提供融资等多项违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则规定，被处以罚款 4880 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国家开发银行债券进行了投资。

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	90,003,085.83
4	应收申购款	4,793,158.98
5	其他应收款	-

6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	94,796,244.81

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	12,360,545,191.61	467,621,861.37
报告期期间基金总申购份额	75,637,738,778.25	580,073,295.22
报告期期间基金总赎回份额	74,671,926,390.60	656,377,430.53
报告期期末基金份额总额	13,326,357,579.26	391,317,726.06

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	红利再投	2020-10-09	112,476.92	112,476.92	-
2	红利再投	2020-10-12	36,307.48	36,307.48	-
3	红利再投	2020-10-13	14,306.76	14,306.76	-
4	红利再投	2020-10-14	13,346.38	13,346.38	-
5	红利再投	2020-10-15	13,567.68	13,567.68	-
6	申赎	2020-10-16	12,000,000.00	-12,000,000.00	-
7	红利再投	2020-10-16	12,051.41	12,051.41	-
8	红利再投	2020-10-19	33,951.07	33,951.07	-
9	红利再投	2020-10-20	11,240.03	11,240.03	-
10	申赎	2020-10-21	72,000,000.00	-72,000,000.00	-
11	红利再投	2020-10-21	11,314.31	11,314.31	-
12	红利再投	2020-10-22	6,830.39	6,830.39	-
13	申赎	2020-10-23	5,000,000.00	-5,000,000.00	-
14	红利再投	2020-10-23	6,946.83	6,946.83	-

15	红利再投	2020-10-26	21,884.66	21,884.66	-
16	红利再投	2020-10-27	9,244.55	9,244.55	-
17	红利再投	2020-10-28	6,608.04	6,608.04	-
18	红利再投	2020-10-29	6,660.00	6,660.00	-
19	红利再投	2020-10-30	6,790.64	6,790.64	-
20	红利再投	2020-11-02	21,725.12	21,725.12	-
21	红利再投	2020-11-03	7,966.94	7,966.94	-
22	红利再投	2020-11-04	6,822.38	6,822.38	-
23	红利再投	2020-11-05	6,454.05	6,454.05	-
24	红利再投	2020-11-06	6,040.31	6,040.31	-
25	红利再投	2020-11-09	19,723.42	19,723.42	-
26	红利再投	2020-11-10	6,624.19	6,624.19	-
27	红利再投	2020-11-11	6,649.86	6,649.86	-
28	红利再投	2020-11-12	9,098.44	9,098.44	-
29	红利再投	2020-11-13	6,854.59	6,854.59	-
30	红利再投	2020-11-16	21,107.73	21,107.73	-
31	红利再投	2020-11-17	8,736.30	8,736.30	-
32	红利再投	2020-11-18	7,004.81	7,004.81	-
33	红利再投	2020-11-19	7,175.85	7,175.85	-
34	红利再投	2020-11-20	9,779.14	9,779.14	-
35	红利再投	2020-11-23	20,721.18	20,721.18	-
36	红利再投	2020-11-24	7,149.21	7,149.21	-
37	红利再投	2020-11-25	7,232.16	7,232.16	-
38	红利再投	2020-11-26	9,132.30	9,132.30	-
39	申赎	2020-11-27	10,000,000.00	10,000,000.00	-
40	红利再投	2020-11-27	7,319.76	7,319.76	-
41	红利再投	2020-11-30	28,245.47	28,245.47	-
42	红利再投	2020-12-01	12,572.91	12,572.91	-

43	红利再投	2020-12-02	9,376.94	9,376.94	-
44	申赎	2020-12-03	10,000,000.00	10,000,000.00	-
45	红利再投	2020-12-03	8,322.07	8,322.07	-
46	申赎	2020-12-04	10,000,000.00	10,000,000.00	-
47	红利再投	2020-12-04	8,849.22	8,849.22	-
48	申赎	2020-12-07	10,000,000.00	10,000,000.00	-
49	红利再投	2020-12-07	27,534.82	27,534.82	-
50	申赎	2020-12-08	10,000,000.00	10,000,000.00	-
51	红利再投	2020-12-08	13,309.06	13,309.06	-
52	申赎	2020-12-09	10,000,000.00	10,000,000.00	-
53	红利再投	2020-12-09	12,405.13	12,405.13	-
54	红利再投	2020-12-10	11,759.21	11,759.21	-
55	红利再投	2020-12-11	11,812.97	11,812.97	-
56	申赎	2020-12-14	10,000,000.00	10,000,000.00	-
57	红利再投	2020-12-14	35,539.74	35,539.74	-
58	申赎	2020-12-15	10,000,000.00	10,000,000.00	-
59	红利再投	2020-12-15	12,487.95	12,487.95	-
60	红利再投	2020-12-16	17,475.07	17,475.07	-
61	申赎	2020-12-17	10,000,000.00	10,000,000.00	-
62	红利再投	2020-12-17	13,503.87	13,503.87	-
63	红利再投	2020-12-18	13,938.66	13,938.66	-
64	申赎	2020-12-21	10,000,000.00	10,000,000.00	-
65	红利再投	2020-12-21	43,374.77	43,374.77	-
66	申赎	2020-12-22	10,000,000.00	10,000,000.00	-
67	红利再投	2020-12-22	16,732.91	16,732.91	-
68	红利再投	2020-12-23	15,742.02	15,742.02	-
69	申赎	2020-12-24	10,000,000.00	10,000,000.00	-
70	红利再投	2020-12-24	15,661.58	15,661.58	-

71	红利再投	2020-12-25	16,685.58	16,685.58	-
72	红利再投	2020-12-28	49,883.42	49,883.42	-
73	申赎	2020-12-29	21,000,000.00	-21,000,000.00	-
74	红利再投	2020-12-29	16,907.14	16,907.14	-
75	红利再投	2020-12-30	15,740.19	15,740.19	-
76	红利再投	2020-12-31	15,720.57	15,720.57	-
合计			230,970,426.16	10,970,426.16	

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
2021 年 1 月 21 日