

景顺长城货币市场证券投资基金 2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 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 4 月 22 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 4 月 21 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 03 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	33,882,050,740.50 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	33,124,218,650.78 份	757,832,089.72 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（2021年1月1日-2021年3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	146,866,895.46	4,501,101.87
2. 本期利润	146,866,895.46	4,501,101.87
3. 期末基金资产净值	33,124,218,650.78	757,832,089.72

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	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	0.5902%	0.0010%	0.3329%	0.0000%	0.2573%	0.0010%
过去六个月	1.1899%	0.0010%	0.6722%	0.0000%	0.5177%	0.0010%
过去一年	2.0991%	0.0014%	1.3472%	0.0000%	0.7519%	0.0014%
过去三年	7.3972%	0.0026%	4.0500%	0.0000%	3.3472%	0.0026%
过去五年	14.1809%	0.0032%	6.7472%	0.0000%	7.4337%	0.0032%
自基金运作起始日起至今	51.4589%	0.0060%	27.1692%	0.0019%	24.2897%	0.0041%

景顺长城货币 B

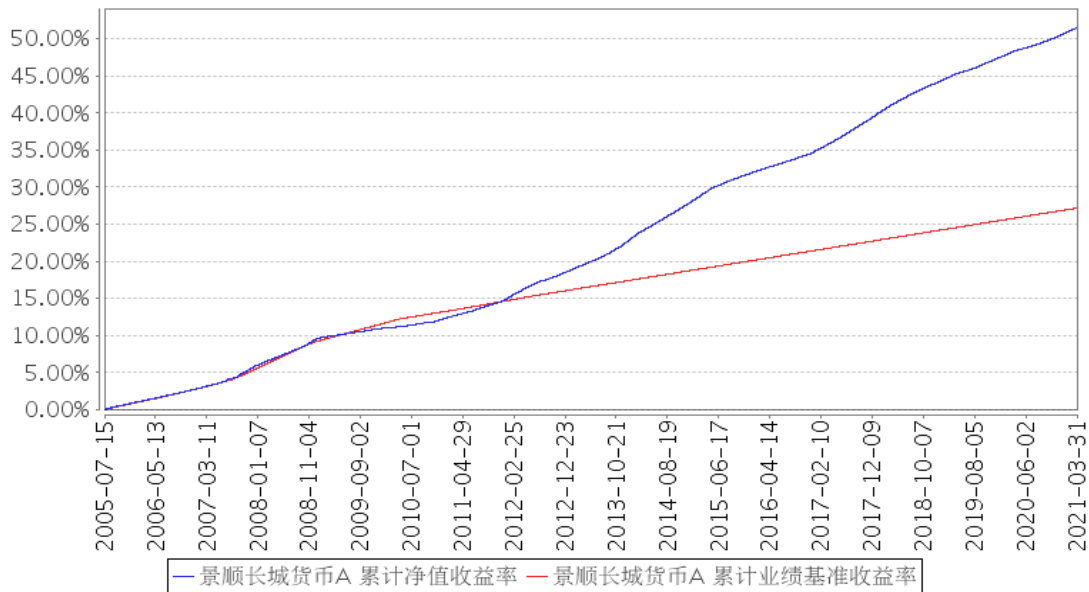
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6492%	0.0010%	0.3329%	0.0000%	0.3163%	0.0010%
过去六个月	1.3103%	0.0010%	0.6722%	0.0000%	0.6381%	0.0010%
过去一年	2.3428%	0.0014%	1.3472%	0.0000%	0.9956%	0.0014%
过去三年	8.1692%	0.0026%	4.0500%	0.0000%	4.1192%	0.0026%
过去五年	15.5528%	0.0032%	6.7472%	0.0000%	8.8056%	0.0032%
自基金运作起始日起至今	39.8063%	0.0055%	14.9202%	0.0001%	24.8861%	0.0054%

注：1、本基金自 2010 年 4 月 30 日起实行份额分级；

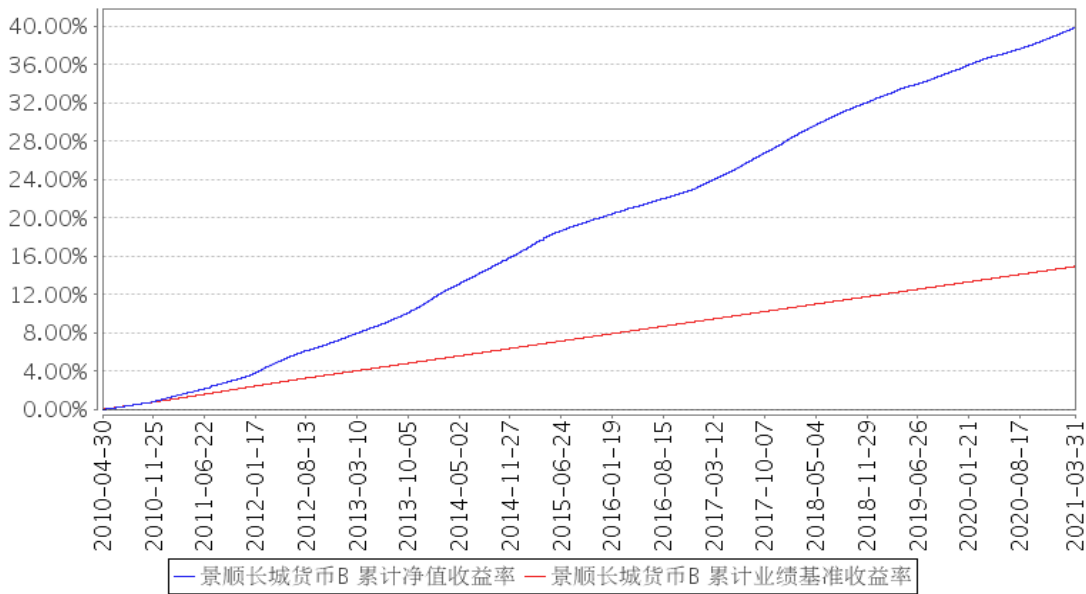
2、自 2019 年 6 月 17 日起本基金的收益分配方式由每日分配，按月结转份额改为每日分配，按日结转份额。

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

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	-	7 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	-	10 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 3 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

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

在市场走势方面，货币市场收益率曲线大幅波动，1 年期国股同业存单于 1 月中旬触及 2.8% 低位后迅速反弹至 3.17% 高点，并持续至 3 月中旬才再次调头下行。年初资金面转松，收益率延续了去年末的下行趋势，并且期限利差相对较窄。在经历了 1 月底大幅调整后，市场对货币政策宽松预期被打破，在随后的时间里趋于谨慎，定价也更为有效，表现为货币市场收益率全线上行，期限利差先压缩再走阔。同时银行间杠杆规模保持合理水平，春节后市场仍较为宽松，但每日回购成交量基本维持在 4 万亿上下，较 1 月上旬宽松阶段接近 5 万亿的融资水平明显下降。

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，根据市场变化及时调整组合策略。年初资金面极度宽松，组合以短久期资产和回购融出为主，通过提高杠杆比例来增厚收益。在 1 月末市场大幅收紧，组合提前降低杠杆水平并通过配置长长期存款拉长久期。春节期间，组合规模增长较快，在收益率仍处于高位的过程中，组合保持长长期，配置上多以同业存单

和存款为主，在提高静态收益的同时避免流动性冲击造成负偏离。3 月中旬后市场收益率下行明显，资金面相对宽松，组合适当降低久期，增加了短期回购的配置占比。

对于后续宏观场景的判断仍维持“稳货币、紧信用”的观点，从经济运行情况来看上半年经济仍有惯性，但经济扩张势头在边际上已经出现了放缓。货币政策方面，至 4 月份可能面临变盘，缴税大月以及政府债券加速发行等被动回收因素是主要的逻辑，也可以更好观察央行的货币政策态度。

二季度流动性扰动因素较多，4 月份缴税规模一般在万亿以上，缴税走款集中的 2-3 天银行间流动性压力骤增；二季度地方政府债供给开始加速，地方债发行与财政投放仍然有一定时滞，特别是供给刚刚开始之际，无法形成有效循环，4 月、5 月政府债券的发行整体上带来流动性回笼；4 月份全市场同业存单到期量 1.6 万亿，其中 AAA 评级的主体到期 1.2 万亿，银行补充流动性缺口的需求仍较为明显；因翘尾因素以及大宗商品涨价影响，PPI 将在二季度到达阶段性高点，需重视 PPI 走高对于货币政策放松的掣肘。目前，市场对上述利空因素已经预期较为充分，甚至对 4 月份流动性谨慎判断形成比较一致的预期，因此预计期限利差仍将维持在较高水平，同时当前 1 年期国股 CD 与 MLF 利差仅为 10bp，预计进一步压缩的空间有限，因此预计收益率曲线在缴税前可能再次走阔，缴税期间因流动性收紧可能长短端仍会有所上行，但短端上行幅度更大，期限利差走平。

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。季度初得益于 3 月末财政投放，预计资金面较为宽松，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。收益率上行可能会提前税期兑现，而缴税期间的流动性冲击更可能对短端影响较大，因此组合将适时降低短端债券占比，若曲线上行至前期高点，组合将配置中长期资产以拉长久期，并提前降低杠杆水平以应对可能的资金面收紧。同时组合合理安排资产到期，重点关注 618 等促销活动后可能的集中赎回，并加大交易策略的使用以增厚组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2021 年 1 季度，景顺长城货币 A 类净值收益率为 0.5902%，业绩比较基准收益率为 0.3329%。

2021 年 1 季度，景顺长城货币 B 类净值收益率为 0.6492%，业绩比较基准收益率为 0.3329%。

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	7,743,446,548.34	22.27
	其中：债券	7,743,446,548.34	22.27
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	8,067,195,475.83	23.20
	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	18,784,702,947.18	54.03
4	其他资产	170,986,789.86	0.49
5	合计	34,766,331,761.21	100.00

注：银行存款和结算备付金合计中包含定期存款 18,780,000,000.00 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	2.49	
	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	866,799,166.60	2.56
	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	78
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	67

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	40.34	2.56
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动	-	-

	利率债		
2	30 天（含）—60 天	20.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	6.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	15.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	19.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	102.11	2.56

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	249,843,769.65	0.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,481,618,413.64	4.37
	其中：政策性金融债	1,481,618,413.64	4.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,879,785,673.95	5.55
6	中期票据	40,190,488.10	0.12
7	同业存单	4,092,008,203.00	12.08
8	其他	-	-
9	合计	7,743,446,548.34	22.85
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	112110077	21 兴业银行 CD077	4,000,000	398,745,623.00	1.18
2	112110093	21 兴业银行 CD093	4,000,000	398,491,823.45	1.18
3	112113018	21 浙商银行 CD018	3,000,000	299,043,377.75	0.88
4	180208	18 国开 08	2,300,000	230,240,147.47	0.68
5	012100516	21 中电投 SCP006	2,200,000	219,986,294.58	0.65
6	180212	18 国开 12	2,000,000	200,810,331.43	0.59

7	012003907	20 中电投 SCP031	2,000,000	200,036,831.96	0.59
8	112016106	20 上海银行 CD106	2,000,000	199,637,866.82	0.59
9	200211	20 国开 11	2,000,000	199,598,309.76	0.59
10	112112012	21 北京银行 CD012	2,000,000	199,545,006.15	0.59

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	0.0661%
报告期内偏离度的最低值	-0.0075%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0219%

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、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浙商银行进行了投资。

2、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 年绩效考核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上海银行进行了投资。

3、北京银行股份有限公司(以下简称“北京银行”,股票代码:601169)于 2020 年 12 月 30 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〕45 号)。其因对外销售虚假金融产品等多项问题,违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条的规定,被处以 3940 万元罚款。

北京银行于 2020 年 12 月 23 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〕41 号)。其因现金管理业务内部控制存在缺陷等问题,违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条的规定,被处以 350 万元罚款。

北京银行于 2020 年 7 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〔2020〕23 号)。其因同业投资对资产转让业务承担回购义务,同业投资资产风险分类调整不及时、延缓风险暴露等问题,违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条、第四十八条的规定,被处以 150 万元罚款。

2020 年 5 月 14 日,北京银行因未按照规定进行国际收支统计申报、未按照规定报送财务会计报告、统计报表等资料的问题,违反了《国际收支统计申报办法》、《银行办理结售汇业务管理办法》等相关规定,收到国家外汇管理局北京外汇管理部出具的行政处罚决定书(京汇罚〔2020〕6 号),被处以 14 万元罚款。

2021 年 2 月 5 日,北京银行因未能确保交易信息的真实性、完整性、可追溯性以及支付全流程中的一致性,未按规定开展条码支付业务等多项违法违规行为,收到中国人民银行营业管理部出具的行政处罚决定书(银管罚〔2021〕4 号),被给予警告,没收违法所得 50.317056 万元,并处罚款 451 万元,罚没合计 501.317056 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北京银行进行了投资。

4、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。

5、兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码：601166）因其信用卡中心于 2020 年 10 月 22 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)23 号)。其因信用卡授信审批严重违反审慎经营规则问题，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 50 万元罚款。

兴业银行于 2020 年 9 月 4 日收到中国人民银行福州中心支行出具的行政处罚决定书(福银罚字〔2020〕35 号)。其因为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定等多项违法违规行为，被给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。

兴业银行于 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。

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	163,125,841.13
4	应收申购款	7,860,948.73
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	170,986,789.86

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	13,326,357,579.26	391,317,726.06
报告期期间基金总申购份额	120,009,370,679.46	1,343,407,885.44
报告期期间基金总赎回份额	100,211,509,607.94	976,893,521.78
报告期期末基金份额总额	33,124,218,650.78	757,832,089.72

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	2021-01-04	62,917.50	62,917.50	-
2	红利再投	2021-01-05	15,239.89	15,239.89	-
3	申赎	2021-01-06	10,000,000.00	10,000,000.00	-
4	红利再投	2021-01-06	14,951.06	14,951.06	-
5	申赎	2021-01-07	10,000,000.00	10,000,000.00	-
6	红利再投	2021-01-07	15,215.69	15,215.69	-
7	申赎	2021-01-08	10,000,000.00	10,000,000.00	-
8	红利再投	2021-01-08	15,420.96	15,420.96	-
9	申赎	2021-01-11	10,000,000.00	10,000,000.00	-
10	红利再投	2021-01-11	47,751.32	47,751.32	-
11	申赎	2021-01-12	10,000,000.00	10,000,000.00	-
12	红利再投	2021-01-12	16,234.10	16,234.10	-

13	申赎	2021-01-13	10,000,000.00	10,000,000.00	-
14	红利再投	2021-01-13	16,884.89	16,884.89	-
15	申赎	2021-01-14	10,000,000.00	10,000,000.00	-
16	红利再投	2021-01-14	17,537.31	17,537.31	-
17	申赎	2021-01-15	10,000,000.00	10,000,000.00	-
18	红利再投	2021-01-15	18,115.50	18,115.50	-
19	申赎	2021-01-18	10,000,000.00	10,000,000.00	-
20	红利再投	2021-01-18	61,190.42	61,190.42	-
21	申赎	2021-01-19	10,000,000.00	10,000,000.00	-
22	红利再投	2021-01-19	33,463.28	33,463.28	-
23	申赎	2021-01-20	10,000,000.00	10,000,000.00	-
24	红利再投	2021-01-20	20,243.16	20,243.16	-
25	申赎	2021-01-21	10,000,000.00	10,000,000.00	-
26	红利再投	2021-01-21	21,531.44	21,531.44	-
27	申赎	2021-01-22	10,000,000.00	10,000,000.00	-
28	红利再投	2021-01-22	22,125.54	22,125.54	-
29	申赎	2021-01-25	10,000,000.00	10,000,000.00	-
30	红利再投	2021-01-25	70,078.89	70,078.89	-
31	申赎	2021-01-26	10,000,000.00	10,000,000.00	-
32	红利再投	2021-01-26	39,724.75	39,724.75	-
33	申赎	2021-01-27	10,000,000.00	10,000,000.00	-
34	红利再投	2021-01-27	25,587.04	25,587.04	-
35	申赎	2021-01-28	10,000,000.00	10,000,000.00	-
36	红利再投	2021-01-28	25,305.97	25,305.97	-
37	申赎	2021-01-29	10,000,000.00	10,000,000.00	-
38	红利再投	2021-01-29	21,746.63	21,746.63	-
39	申赎	2021-02-01	10,000,000.00	10,000,000.00	-
40	红利再投	2021-02-01	74,483.23	74,483.23	-

41	红利再投	2021-02-02	29,542.56	29,542.56	-
42	申赎	2021-02-03	10,000,000.00	10,000,000.00	-
43	红利再投	2021-02-03	42,764.36	42,764.36	-
44	申赎	2021-02-04	10,000,000.00	10,000,000.00	-
45	红利再投	2021-02-04	42,728.83	42,728.83	-
46	申赎	2021-02-05	10,000,000.00	10,000,000.00	-
47	红利再投	2021-02-05	34,484.68	34,484.68	-
48	申赎	2021-02-08	10,000,000.00	10,000,000.00	-
49	红利再投	2021-02-08	97,222.03	97,222.03	-
50	红利再投	2021-02-09	33,547.83	33,547.83	-
51	申赎	2021-02-10	10,000,000.00	10,000,000.00	-
52	红利再投	2021-02-10	33,234.28	33,234.28	-
53	申赎	2021-02-18	10,000,000.00	10,000,000.00	-
54	红利再投	2021-02-18	260,106.68	260,106.68	-
55	红利再投	2021-02-19	37,400.72	37,400.72	-
56	申赎	2021-02-22	10,000,000.00	10,000,000.00	-
57	红利再投	2021-02-22	95,598.59	95,598.59	-
58	申赎	2021-02-23	10,000,000.00	10,000,000.00	-
59	红利再投	2021-02-23	37,706.50	37,706.50	-
60	申赎	2021-02-24	10,000,000.00	10,000,000.00	-
61	红利再投	2021-02-24	34,492.85	34,492.85	-
62	申赎	2021-02-25	10,000,000.00	10,000,000.00	-
63	红利再投	2021-02-25	35,158.03	35,158.03	-
64	申赎	2021-02-26	10,000,000.00	10,000,000.00	-
65	红利再投	2021-02-26	34,200.57	34,200.57	-
66	申赎	2021-03-01	10,000,000.00	10,000,000.00	-
67	红利再投	2021-03-01	105,007.63	105,007.63	-
68	申赎	2021-03-02	10,000,000.00	10,000,000.00	-

69	红利再投	2021-03-02	35,096.01	35,096.01	-
70	申赎	2021-03-03	10,000,000.00	10,000,000.00	-
71	红利再投	2021-03-03	35,567.55	35,567.55	-
72	申赎	2021-03-04	10,000,000.00	10,000,000.00	-
73	红利再投	2021-03-04	33,572.25	33,572.25	-
74	申赎	2021-03-05	6,000,000.00	6,000,000.00	-
75	红利再投	2021-03-05	37,109.88	37,109.88	-
76	红利再投	2021-03-08	112,728.33	112,728.33	-
77	申赎	2021-03-09	10,000,000.00	10,000,000.00	-
78	红利再投	2021-03-09	35,856.24	35,856.24	-
79	红利再投	2021-03-10	37,649.42	37,649.42	-
80	红利再投	2021-03-11	37,380.74	37,380.74	-
81	红利再投	2021-03-12	37,401.12	37,401.12	-
82	申赎	2021-03-15	10,000,000.00	10,000,000.00	-
83	红利再投	2021-03-15	113,737.93	113,737.93	-
84	申赎	2021-03-16	10,000,000.00	10,000,000.00	-
85	红利再投	2021-03-16	38,663.69	38,663.69	-
86	红利再投	2021-03-17	39,406.99	39,406.99	-
87	申赎	2021-03-18	10,000,000.00	10,000,000.00	-
88	红利再投	2021-03-18	39,439.92	39,439.92	-
89	申赎	2021-03-19	4,000,000.00	-4,000,000.00	-
90	红利再投	2021-03-19	40,173.14	40,173.14	-
91	红利再投	2021-03-22	120,609.21	120,609.21	-
92	申赎	2021-03-23	20,000,000.00	-20,000,000.00	-
93	红利再投	2021-03-23	40,218.11	40,218.11	-
94	红利再投	2021-03-24	39,108.69	39,108.69	-
95	申赎	2021-03-25	7,000,000.00	-7,000,000.00	-
96	红利再投	2021-03-25	38,915.56	38,915.56	-

97	申赎	2021-03-26	27,000,000.00	-27,000,000.00	-
98	红利再投	2021-03-26	38,442.78	38,442.78	-
99	红利再投	2021-03-29	110,673.97	110,673.97	-
100	红利再投	2021-03-30	36,922.89	36,922.89	-
101	红利再投	2021-03-31	37,013.77	37,013.77	-
合计			446,744,632.90	330,744,632.90	

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 4 月 22 日