

景顺长城景丰货币市场基金 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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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 | 景顺长城景丰货币 |
| 场内简称 | 无 |
| 基金主代码 | 000701 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 9 月 16 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 16,154,272,281.58 份 |
| 投资目标 | 本基金在保持基金资产安全性和高流动性的基础上，通过运用各种投资工具及投资策略，力争获取高于业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金根据对短期利率变动的合理预判，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用定性分析和定量分析方法，综合分析宏观经济指标，包括全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平变动趋势、利率水平和市场预期、通货膨胀率、货币供应量等，对短期利率走势进行综合判断，同时分析央行公开市场操作、主流资金的短期投资倾向、债券供给、货币市场与资本市场资金互动等，并根据动态预期决定和调整组合的平均剩余期限。预期市场利率水平上升，适度缩短投资组合的平均剩余期限，以降低组合下跌风险；预期市场利率水平下降，适度延长投资组合的平均剩余期限，以分享债券价格上升的收益。 |
| 业绩比较基准 | 同期七天通知存款利率（税后）。 |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混 |

| | | |
|-----------------|------------------|---------------------|
| | 合型基金、债券型基金。 | |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 景顺长城景丰货币 A | 景顺长城景丰货币 B |
| 下属分级基金的交易代码 | 000701 | 000707 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 412,723,680.68 份 | 15,741,548,600.90 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） | |
|-------------|-------------------------------------|-------------------|
| | 景顺长城景丰货币 A | 景顺长城景丰货币 B |
| 1. 本期已实现收益 | 2,119,601.06 | 115,385,800.28 |
| 2. 本期利润 | 2,119,601.06 | 115,385,800.28 |
| 3. 期末基金资产净值 | 412,723,680.68 | 15,741,548,600.90 |

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

景顺长城景丰货币 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 | 0.5586% | 0.0008% | 0.3329% | 0.0000% | 0.2257% | 0.0008% |
| 过去六个月 | 1.1565% | 0.0007% | 0.6722% | 0.0000% | 0.4843% | 0.0007% |
| 过去一年 | 2.0315% | 0.0013% | 1.3472% | 0.0000% | 0.6843% | 0.0013% |
| 过去三年 | 7.5644% | 0.0015% | 4.0500% | 0.0000% | 3.5144% | 0.0015% |
| 过去五年 | 14.7144% | 0.0021% | 6.7472% | 0.0000% | 7.9672% | 0.0021% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.1392% | 0.0031% | 8.8286% | 0.0000% | 12.3106% | 0.0031% |

景顺长城景丰货币 B

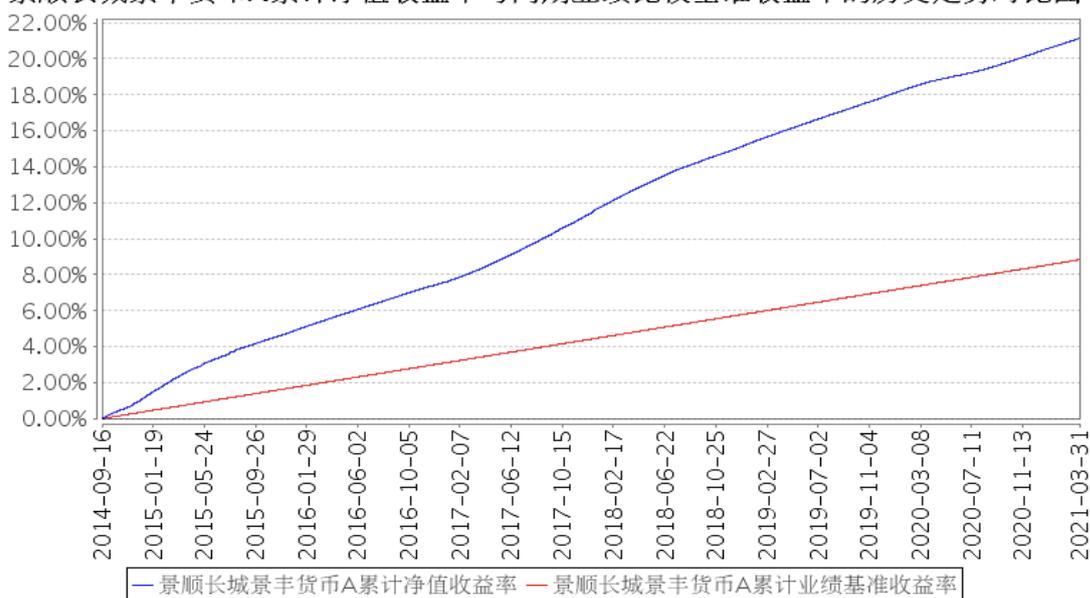
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|---------|-----------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.6179% | 0.0008% | 0.3329% | 0.0000% | 0.2850% | 0.0008% |
| 过去六个月 | 1.2773% | 0.0007% | 0.6722% | 0.0000% | 0.6051% | 0.0007% |

| | | | | | | |
|------------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去一年 | 2.2754% | 0.0013% | 1.3472% | 0.0000% | 0.9282% | 0.0013% |
| 过去三年 | 8.3402% | 0.0015% | 4.0500% | 0.0000% | 4.2902% | 0.0015% |
| 过去五年 | 16.0964% | 0.0021% | 6.7472% | 0.0000% | 9.3492% | 0.0021% |
| 自基金合同生效起至今 | 23.0511% | 0.0031% | 8.8286% | 0.0000% | 14.2225% | 0.0031% |

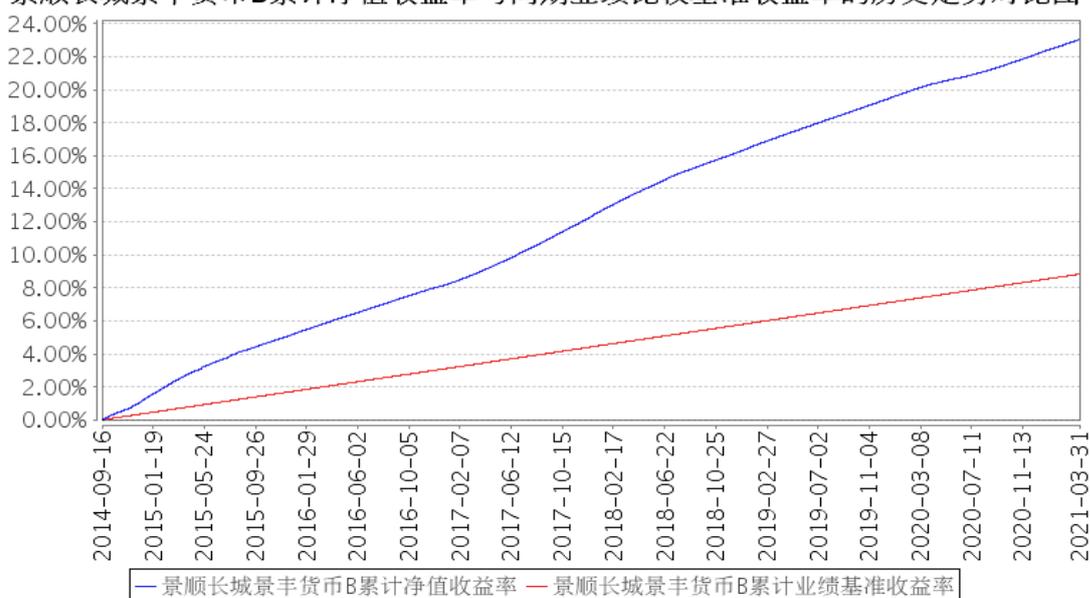
注：本基金的收益分配为每日分配，按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效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

景顺长城景丰货币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



景顺长城景丰货币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：本基金的建仓期为 2014 年 9 月 16 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合符合基金合同的有关约定。

§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 12 月 12 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”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指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、《景顺长城景丰货币市场基金基金合同》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

1-2 月经济增长数据基本上延续“生产强需求弱”的特征，外需等拉动工业生产维持了高景气度，相对而言总需求偏弱，其中房地产投资以及出口仍是最明显的支撑，而消费的恢复依然显著弱于季节性。从节后的复工情况来看，也并未出现显著超越季节性的强势，螺纹库存近来开始回落但绝对量水平仍处于历史高位，这部分的需求仍需要继续观察。货币政策方面，央行 1 月底收紧资金面，在控杠杆抑泡沫的效果显现后，在春节、“两会”、季末等时间窗口上均维持了中性偏宽松的货币政策态度。信用方面，由于 1-2 月信贷社融数据无论从总量还是结构上均偏强，3 月份因季度平滑以及政府债券发行较晚开始等因素，预计 3 月份贷款、社融增速可能均趋于往下，进一步推动“紧信用”环境与预期。

货币市场方面，一季度央行在公开市场投放方面相对克制，资金面波动加大。开年伊始大幅净回笼，并且在 1 月底财政投放不及预期之际并未投放，造成 1 月底资金面骤然收紧。对于春节期间流动性维稳方面，政策工具的选择上也不同于往年，仅通过 7 天、14 天公开市场投放短期流动性，且春节后及时收回。在中长期流动性投放方面，降准、定向降准缺席，同时 MLF 的投放也仅仅对冲到期量，1 月份甚至并未完全对冲当月到期的 MLF 和 TMLF 总量。整体来看，一季度央行的政策态度基本上印证了货币政策例会上提出的“灵活精准、合理适度”，为控制杠杆率以及防范资产价格泡沫，收紧流动性也只是暂时的举措，后续每日开张 100-200 亿公开市场操作，维稳态度彰显。

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，机构集中申购加大了配置难度，组合以短久期资产和回购融出为主。1 月末市场大幅收紧，短端资产收益率上行明显，叠加客户赎回使组合产生小幅负偏离。

流动性冲击过后，预计后期流动性无大碍，在收益率仍处于高位的过程中，组合逐步拉长久期，配置上多以同业存单和信用债为主，提高组合流动性，以应对可能再次出现的流动性冲击。3 月中旬后市场收益率下行明显，资金面相对宽松，组合逐步降低久期。临近季末，客户赎回造成十大客户集中度超 50%，但对各项指标冲击较小。

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，配置长期限资产以拉长久期，并提前降低杠杆水平以应对可能的资金面收紧。同时组合将合理安排资产到期，重点关注半年末时点上的集中赎回，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，景丰货币 A 净值收益率为 0.5586%，业绩比较基准收益率为 0.3329%；景丰货币 B 净值收益率为 0.6179%，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 | 7,188,445,654.97 | 42.46 |
| | 其中：债券 | 7,188,445,654.97 | 42.46 |
| | 资产支持证 券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 3,952,364,328.54 | 23.34 |
| | 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 | 5,705,044,129.31 | 33.70 |
| 4 | 其他资产 | 84,639,777.83 | 0.50 |
| 5 | 合计 | 16,930,493,890.65 | 100.00 |

注：银行存款和结算备付金合计中包含定期存款 5,700,000,000.00 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 | 2.70 | |
| | 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 | 753,199,303.40 | 4.66 |
| | 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基金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基金资产净值的 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 | 55 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 62 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 45 |

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 | 46.00 | 4.66 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 27.42 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 12.80 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 4.33 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 13.74 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 104.28 | 4.66 |

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 | 49,970,432.92 | 0.31 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 940,358,164.89 | 5.82 |
| | 其中：政策性金融债 | 840,012,356.31 | 5.20 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,199,182,349.72 | 7.42 |
| 6 | 中期票据 | 340,694,677.83 | 2.11 |
| 7 | 同业存单 | 4,658,240,029.61 | 28.84 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 7,188,445,654.97 | 44.50 |
| 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 | 042000262 | 20 电网 CP005 | 2,500,000 | 249,495,895.58 | 1.54 |
| 2 | 180208 | 18 国开 08 | 2,300,000 | 230,252,738.08 | 1.43 |

| | | | | | |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|------|
| 3 | 072100006 | 21 中信建投 CP001 | 2,000,000 | 199,997,591.40 | 1.24 |
| 4 | 112017109 | 20 光大银行 CD109 | 2,000,000 | 199,730,733.69 | 1.24 |
| 5 | 112015182 | 20 民生银行 CD182 | 2,000,000 | 199,620,167.97 | 1.24 |
| 6 | 112112012 | 21 北京银行 CD012 | 2,000,000 | 199,545,006.15 | 1.24 |
| 7 | 112104002 | 21 中国银行 CD002 | 2,000,000 | 199,448,835.30 | 1.23 |
| 8 | 112012044 | 20 北京银行 CD044 | 2,000,000 | 199,364,533.68 | 1.23 |
| 9 | 112017196 | 20 光大银行 CD196 | 2,000,000 | 199,246,177.94 | 1.23 |
| 10 | 112111071 | 21 平安银行 CD071 | 2,000,000 | 199,245,966.27 | 1.23 |

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 | 0.0795% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0251% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0421% |

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、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平安银行进行了投资。

2、中国民生银行股份有限公司（以下简称“民生银行”，股票代码：600016）于 2020 年 7

月 14 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〕43 号)。其因违反宏观调控政策、违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资等多项问题,违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十条、第二十一条、第四十六条第(一)、(五)项,《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第五十五条、第七十四条规定和相关审慎经营规则的规定,被处以没收违法所得 296.47 万元,罚款 10486.47 万元,罚没合计 10782.94 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民生银行进行了投资。

3、2020 年 4 月 20 日,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)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。

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。

4、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。

5、中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”,股票代码:601988,3988.HK)于 2020 年 12 月 1 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〕60 号)。其因“原油宝”产品风险事件相关违法违规行,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 5050 万元罚款。

中国银行于 2020 年 4 月 20 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〕4 号)。其因中国银行监管标准化数据(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,被处以 270 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中国银行进行了投资。

6、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。

7、其余四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 | 79,612,817.60 |
| 4 | 应收申购款 | 5,026,960.23 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 84,639,777.83 |

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 | 景顺长城景丰货币 A | 景顺长城景丰货币 B |
|--------------|----------------|-------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 371,136,115.62 | 16,471,161,004.40 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 517,309,555.87 | 16,290,444,180.19 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 475,721,990.81 | 17,020,056,583.69 |
| 报告期期末基金份额总额 | 412,723,680.68 | 15,741,548,600.90 |

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 | 2021-01-06 | 56,000,000.00 | 56,000,000.00 | - |
| 2 | 申赎 | 2021-01-06 | 87,000,000.00 | 87,000,000.00 | - |
| 3 | 申赎 | 2021-01-07 | 53,000,000.00 | 53,000,000.00 | - |
| 4 | 申赎 | 2021-01-08 | 5,000,000.00 | 5,000,000.00 | - |
| 5 | 申赎 | 2021-01-11 | 12,000,000.00 | 12,000,000.00 | - |
| 6 | 申赎 | 2021-01-12 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 7 | 申赎 | 2021-01-13 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 8 | 申赎 | 2021-01-15 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 9 | 红利再投 | 2021-01-15 | 1,486,082.81 | 1,486,082.81 | - |
| 10 | 申赎 | 2021-01-18 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 11 | 申赎 | 2021-01-19 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 12 | 申赎 | 2021-01-19 | 100,000,000.00 | -100,000,000.00 | - |
| 13 | 申赎 | 2021-01-20 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 14 | 申赎 | 2021-01-21 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 15 | 申赎 | 2021-01-22 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 16 | 申赎 | 2021-01-22 | 28,000,000.00 | -28,000,000.00 | - |

| | | | | | |
|----|------|------------|----------------|-----------------|---|
| 17 | 申赎 | 2021-01-25 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 18 | 申赎 | 2021-01-26 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 19 | 申赎 | 2021-01-27 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 20 | 申赎 | 2021-01-28 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 21 | 申赎 | 2021-01-28 | 14,000,000.00 | -14,000,000.00 | - |
| 22 | 申赎 | 2021-01-29 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 23 | 申赎 | 2021-02-01 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 24 | 申赎 | 2021-02-03 | 107,000,000.00 | 107,000,000.00 | - |
| 25 | 申赎 | 2021-02-04 | 22,000,000.00 | 22,000,000.00 | - |
| 26 | 申赎 | 2021-02-05 | 50,000,000.00 | 50,000,000.00 | - |
| 27 | 申赎 | 2021-02-08 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 28 | 申赎 | 2021-02-10 | 22,000,000.00 | 22,000,000.00 | - |
| 29 | 红利再投 | 2021-02-18 | 1,509,051.48 | 1,509,051.48 | - |
| 30 | 申赎 | 2021-02-18 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 31 | 申赎 | 2021-02-22 | 15,000,000.00 | -15,000,000.00 | - |
| 32 | 申赎 | 2021-02-22 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 33 | 申赎 | 2021-02-23 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 34 | 申赎 | 2021-02-24 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 35 | 申赎 | 2021-02-24 | 2,000,000.00 | -2,000,000.00 | - |
| 36 | 申赎 | 2021-02-25 | 198,000,000.00 | -198,000,000.00 | - |
| 37 | 申赎 | 2021-02-25 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 38 | 申赎 | 2021-02-26 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 39 | 申赎 | 2021-03-01 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 40 | 申赎 | 2021-03-02 | 38,000,000.00 | 38,000,000.00 | - |
| 41 | 申赎 | 2021-03-03 | 163,000,000.00 | 163,000,000.00 | - |
| 42 | 申赎 | 2021-03-04 | 100,000,000.00 | 100,000,000.00 | - |
| 43 | 申赎 | 2021-03-09 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 44 | 申赎 | 2021-03-10 | 108,000,000.00 | -108,000,000.00 | - |

| | | | | | |
|----|------|------------|------------------|----------------|---|
| 45 | 申赎 | 2021-03-12 | 84,000,000.00 | -84,000,000.00 | - |
| 46 | 红利再投 | 2021-03-15 | 1,053,042.99 | 1,053,042.99 | - |
| 47 | 申赎 | 2021-03-15 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 48 | 申赎 | 2021-03-16 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 49 | 申赎 | 2021-03-18 | 10,000,000.00 | -10,000,000.00 | - |
| 合计 | | | 1,528,048,177.28 | -89,951,822.72 | |

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丰货币市场基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城景丰货币市场基金基金合同》；
- 3、《景顺长城景丰货币市场基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城景丰货币市场基金托管协议》；
- 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