

景顺长城货币市场证券投资基金 2022 年第 1 季度报告

2022 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：2022 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 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 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	38,840,147,739.81 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	37,896,130,890.41 份	944,016,849.40 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（2022 年 1 月 1 日-2022 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	196,053,041.02	5,672,571.10
2. 本期利润	196,053,041.02	5,672,571.10
3. 期末基金资产净值	37,896,130,890.41	944,016,849.40

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	0.5114%	0.0009%	0.3329%	0.0000%	0.1785%	0.0009%
过去六个月	1.0479%	0.0007%	0.6732%	0.0000%	0.3747%	0.0007%
过去一年	2.1313%	0.0007%	1.3500%	0.0000%	0.7813%	0.0007%
过去三年	6.6469%	0.0019%	4.0500%	0.0000%	2.5969%	0.0019%
过去五年	13.8707%	0.0028%	6.7500%	0.0000%	7.1207%	0.0028%
自基金合同生效起至今	54.6869%	0.0058%	28.5192%	0.0019%	26.1677%	0.0039%

景顺长城货币 B

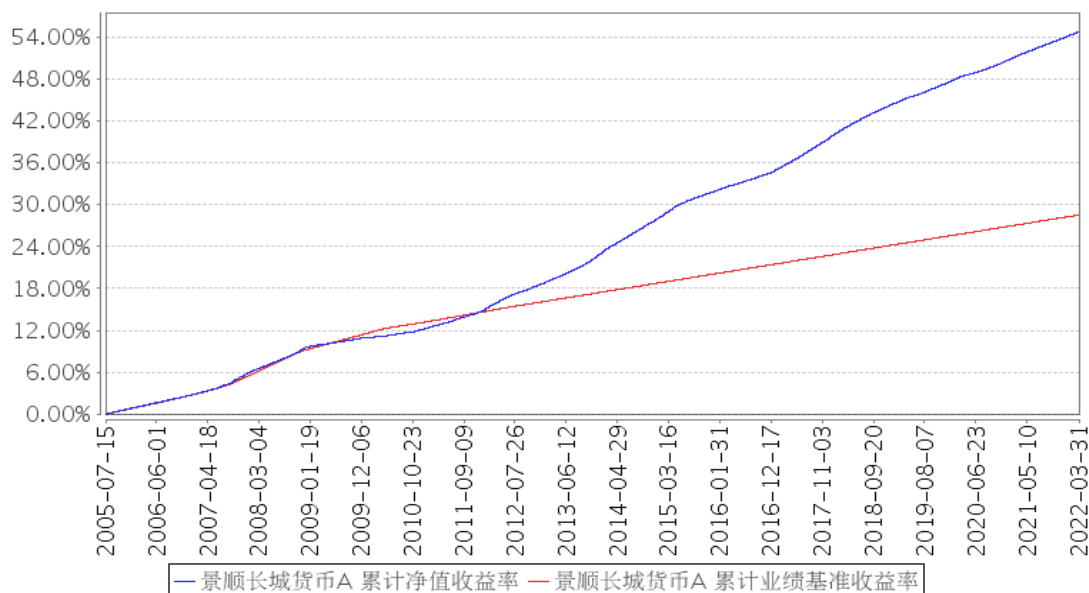
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.5709%	0.0009%	0.3329%	0.0000%	0.2380%	0.0009%
过去六个月	1.1688%	0.0007%	0.6732%	0.0000%	0.4956%	0.0007%
过去一年	2.3766%	0.0007%	1.3500%	0.0000%	1.0266%	0.0007%
过去三年	7.4141%	0.0019%	4.0500%	0.0000%	3.3641%	0.0019%
过去五年	15.2398%	0.0028%	6.7500%	0.0000%	8.4898%	0.0028%
自基金合同生效起至今	43.1289%	0.0052%	16.2702%	0.0001%	26.8587%	0.0051%

注：1、本基金自 2010 年 4 月 30 日起实行份额分级；

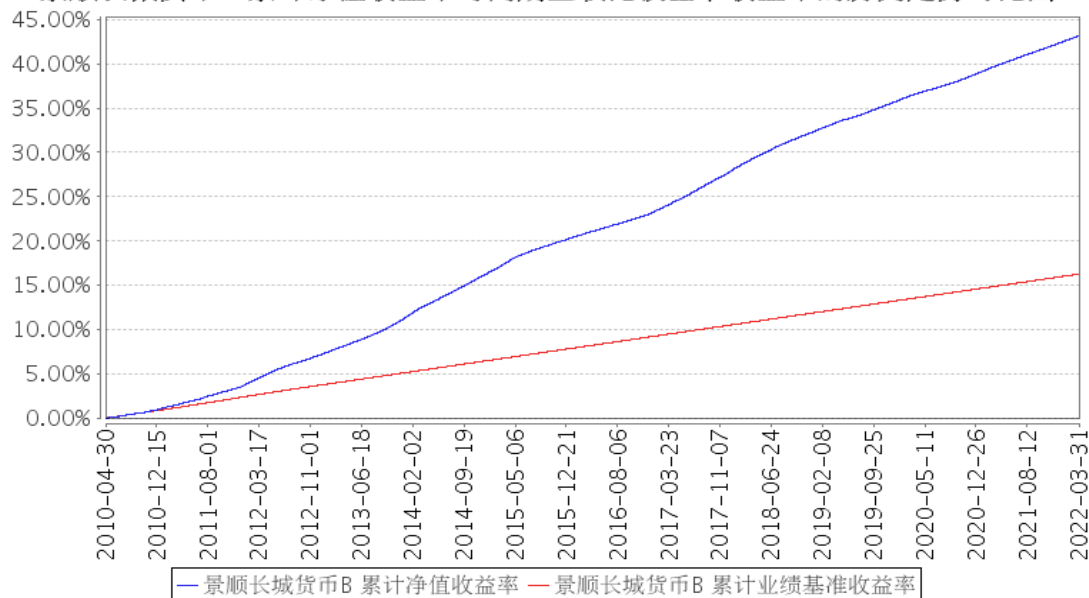
2、自 2019 年 6 月 17 日起本基金的收益分配方式由每日分配，按月结转份额改为每日分配，按日结转份额。

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		
陈威霖	本基金的基金经理	2016年4月20日	-	11年	管理学硕士。曾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，现任固定收益部总经理助理、基金经理。具有11年证券、基金行业从业经验。
米良	本基金的基金经理	2018年11月3日	-	8年	经济学硕士。曾任汇丰银行（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月加入本公司，自2018年11月起担任固定收益部基金经理。具有8年证券、基金行业从业经验。

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 17 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

一季度货币政策延续 2021 年底中央经济工作会议定调，总体稳健偏宽。政策层面稳增长诉求较强，1 月政策操作量价两宽符合预期，1 月 17 日央行操作 7000 亿 MLF 并降息 10bp，并从 17 日开始每日公开市场持续投放 1000-2000 亿资金呵护税期及春节流动性；2 月中旬央行继续向市场传递为流动性保驾护航态度，MLF 超额续作 1000 亿。3 月虽然降准降息等大幅宽松政策落空，但央行仍然是延续月末季末一贯操作向市场进行公开市场投放呵护流动性，机构平稳跨季。

价格方面，1 月份央行调降 MLF 利率 10bp，当季资金价格中枢相应下调，DR007 基本上围绕政策利率上下波动，日均值约为 2.09%。同业存单收益率先下后上，1 月后至 2 月中市场充分定价货币政策宽松预期，1 年期国股行 CD 最低下行至 2.43%，3 月降准降息落空、季节性效应及赎回担忧下，CD 收益率跟随短债快速上行，1 年期国股行 CD 最高上至 2.65% 后小幅回落，货币市场利率曲线陡峭化。

报告期内组合严格遵循公募基金流动性新规中对货币基金运作的规定，根据市场变化及时调整组合策略。一月份央行超预期降息后，市场收益率大幅走低，甚至出现超调，组合调整了平均剩余期限至中性水平，待收益率走高后通过配置年内资产逐步将久期提高至较高水平。配置上，因目前 CD 和同业存款利差不大，考虑到组合已经累积了一定的正偏离，因此增加了 CD 的配置比例，提高组合流动性。一季度，资金面整体比较平稳，利差有限的情况下杠杆收益一般，因此整体杠杆水平处于较低水平，仅在季末时点前收益率有所上行，适当提高了跨季杠杆比例。

一季度海外地缘政治继续推高通胀预期，美联储此轮货币正常化速度也相比此前节奏更快，国内央行大幅宽松工具收到掣肘，但国内经济一季度受本轮奥密克隆疫情影响下行压力较大，多目标下货币政策相比一季度需要权衡，因此二季度政策场景预计将是“稳货币，宽信用”。流动性上继续维持合理充裕，但降准降息等总量政策空间较小，货币政策方面将以再贷款等结构性政策精准滴灌以支持实体经济，宽信用将是二季度政策主线。对应到货币市场方面预计量宽价高，结构性政策下资金价格不会走低，隔夜加权利率维持 2% 左右的平均水平。目前 1Y 同业存单利率仍低于政策利率 30bp，而政策预期收敛下 1Y NCD 利率将逐步回归至 1Y MLF 利率附近。因此货币市场利率曲线预计在二季度继续陡峭化。

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，精细管理组合流动性。在宽信用暂未实现的情况下，央行仍将会保持流动性合理充裕，但降准降息的时间窗口逼仄，组合将延续杠杆策略，但需要及时调整杠杆比例。考虑到跨季后收益率显著下行，组合将自然降低久期，配置上以回购和存款为主，避免产生负偏离。组合将合理安排资产到期，重点关注清明、五一长假前后客户申赎对组合流动性的冲击。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2022 年 1 季度，景顺长城货币 A 类净值收益率为 0.5114%，业绩比较基准收益率为 0.3329%。

2022 年 1 季度，景顺长城货币 B 类净值收益率为 0.5709%，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	15,096,931,659.45	36.23
	其中：债券	15,096,931,659.45	36.23
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	11,145,741,452.86	26.75
	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	15,417,071,285.02	37.00
4	其他资产	8,243,571.64	0.02
5	合计	41,667,987,968.97	100.00

注：1、银行存款和结算备付金合计中包含定期存款 15,380,035,727.78 元。

2、本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”，“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额，下同。

5.2 报告期债券回购融资情况

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	3.00	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	2,808,881,740.58	7.23

	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	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	64

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	41.23	7.23
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	12.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	10.00	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	10.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	32.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	106.82	7.23

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	458,232,712.76	1.18
2	央行票据	-	-

3	金融债券	1,530,685,712.73	3.94
	其中：政策性金融债	1,530,685,712.73	3.94
4	企业债券	176,621,780.62	0.45
5	企业短期融资券	2,940,216,688.68	7.57
6	中期票据	277,019,129.89	0.71
7	同业存单	9,714,155,634.77	25.01
8	其他	-	-
9	合计	15,096,931,659.45	38.87
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	112117122	21 光大银行 CD122	7,000,000	694,691,640.84	1.79
2	012105504	21 南电 SCP016	4,000,000	402,319,488.94	1.04
3	112210046	22 兴业银行 CD046	4,000,000	396,895,268.96	1.02
4	012280466	22 电网 SCP002	3,000,000	300,722,640.46	0.77
5	112292249	22 宁波银行 CD039	3,000,000	299,240,395.21	0.77
6	112113238	21 浙商银行 CD238	3,000,000	298,949,403.36	0.77
7	112213046	22 浙商银行 CD046	3,000,000	298,626,478.16	0.77
8	112216006	22 上海银行 CD006	3,000,000	297,874,821.01	0.77
9	112112104	21 北京银行 CD104	3,000,000	297,813,161.05	0.77
10	042100475	21 电网 CP018	2,700,000	272,536,888.51	0.70

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	0.0437%
报告期内偏离度的最低值	0.0219%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0311%

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、北京银行股份有限公司（以下简称“北京银行”，股票代码：601169）于 2021 年 9 月 26 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〔2021〕26 号）。其因服务收费管理不力，违规收费等问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条等规定，被处以 820 万元罚款。

北京银行于 2021 年 11 月 24 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〔2021〕30 号）。其因发生重要信息系统突发事件但未向监管部门报告，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》第四十六条的规定，被处以 40 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进行了投资。

2、宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”，股票代码：002142）于 2021 年 12 月 29 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〔2021〕81 号）。其因信用卡业务管理不到位，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条等规定，被处以罚款人民币 30 万元。

2021 年 6 月 10 日，宁波银行因代理销售保险不规范，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、第四十八条第（一）项的相关规定，收到宁波银保监局出具的行政处罚决定书（甬银保监罚决字〔2021〕36 号），被处以罚款人民币 25 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

2021 年 7 月 30 日，宁波银行因贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储、开发贷款支用审核不严、房地产贷款放款和支用环节审核不严、贷款资金违规流入房市、房地产贷款资金回流借款人、票据业务开展不审慎，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，收到宁波银保监局出具的行政处罚决定书（甬银保监罚决字〔2021〕57 号），被处以罚款人民币 275 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

2021 年 7 月 13 日，宁波银行因违规为存款人多头开立银行结算账户、超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料等，收到中国人民银行宁波市中心支行出具的行政处罚决定书（甬银处罚字〔2021〕2 号），被给予警告，并处罚款 286.2 万元。

2021 年 7 月 13 日，宁波银行因违反规定办理经常项目外汇业务、违反规定办理资本项目资

金收付，违反了《中华人民共和国外汇管理条例》（2008 年国务院令第 532 号）第十二条及《国家外汇管理局综合司关于完善银行内保外贷外汇管理的通知》（汇综发〔2017〕108 号）第一条、第二条和第三条的相关规定，收到国家外汇管理局宁波市分局出具的行政处罚决定书（甬外管罚〔2021〕7 号），被予以责令改正，罚款 100 万元，没收违法所得 1048476.65 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宁波银行进行了投资。

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 2022 年 3 月 21 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（沪银保监罚决字〔2022〕18 号）。其因逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规行为，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，被处以 490 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、兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码：601166）于 2021 年 8 月 13 日收到中国人民银行出具的行政处罚决定书（银罚字〔2021〕26 号），其因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，被处以罚款人民币 5 万元。

兴业银行于 2022 年 3 月 21 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〔2022〕22 号），其因漏报贸易融资业务 EAST 数据、漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规行为，被处以罚款人民币 350 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。

5、上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”，股票代码：601229）于 2021 年 11 月 19 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（沪银保监罚决字〔2021〕174 号）。其因未按规定报送统计报表，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条等规定，被处以罚款人民币 20 万元。

2021 年 4 月 25 日，上海银行因未按照规定进行信息披露，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）项相关规定，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（沪银保监罚决字〔2021〕31 号），被处以罚款 30 万元。

2021 年 7 月 2 日，上海银行因某笔同业投资房地产企业合规审查严重违反审慎经营规则、某笔经营性物业贷款授信后管理严重违反审慎经营规则、部分个人贷款违规用于购房等，违反了中

《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、《中华人民共和国商业银行法》第七十四条第（三）项、《个人贷款管理暂行办法》第四十二条第（八）项，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（沪银保监罚决字〔2021〕72 号），被处以罚款 460 万元。

2022 年 2 月 14 日，上海银行因同业投资业务违规接受第三方金融机构担保等违规行为，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（沪银保监罚决字〔2022〕13 号），被处以罚款 240 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。

6、2021 年 7 月 26 日，浙商银行股份有限公司（以下简称“浙商银行”，股票代码：601916）因违规开展外汇批发市场业务、违规办理售汇资金偿还外汇贷款等多项问题，违反了《中华人民共和国外汇管理条例》第二十九条和《国家外汇管理局关于调整金融机构进入银行间外汇市场有关管理政策的通知》（汇发〔2014〕48 号）第五条等相关规定，收到国家外汇管理局浙江省分局出具的行政处罚决定书（浙外管罚〔2021〕1 号），被合计没收违法所得 560.3 万元，处 267 万元罚款。

2021 年 10 月 21 日，浙商银行因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，收到中国人民银行出具的行政处罚决定书（银罚字〔2021〕27 号），被处以罚款 65 万元。

2022 年 3 月 21 日，浙商银行因漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据、漏报贸易融资业务 EAST 数据等违法违规行为，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〔2022〕27 号），被处以罚款 380 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。

7、本基金投资前十名证券的其余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	-
4	应收申购款	8,243,571.64
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	8,243,571.64

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

根据财政部《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》（财会〔2017〕7 号）、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》（财会〔2017〕8 号）、《企业会计准则第 24 号—套期会计》（财会〔2017〕9 号）、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（财会〔2017〕14 号）（以上统称新金融工具相关会计准则）和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22 号），并经与托管人协商一致，自 2022 年 1 月 1 日起，本公司对旗下公开募集证券投资基金开始执行新金融工具相关会计准则。

§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	35,876,976,333.47	946,142,817.96
报告期期间基金总申购份额	100,738,578,797.71	298,675,528.02
报告期期间基金总赎回份额	98,719,424,240.77	300,801,496.58
报告期期末基金份额总额	37,896,130,890.41	944,016,849.40

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。

§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	2022-01-04	234,180.41	234,180.41	-
2	红利再投	2022-01-05	58,630.27	58,630.27	-
3	申赎	2022-01-06	5,000,000.00	5,000,000.00	-
4	红利再投	2022-01-06	54,200.93	54,200.93	-
5	红利再投	2022-01-07	52,305.75	52,305.75	-
6	申赎	2022-01-07	5,000,000.00	5,000,000.00	-
7	红利再投	2022-01-10	156,096.17	156,096.17	-
8	红利再投	2022-01-11	66,142.59	66,142.59	-
9	申赎	2022-01-11	5,000,000.00	5,000,000.00	-
10	红利再投	2022-01-12	70,153.70	70,153.70	-
11	红利再投	2022-01-13	63,331.08	63,331.08	-
12	申赎	2022-01-13	5,000,000.00	5,000,000.00	-

13	红利再投	2022-01-14	54,383.66	54,383.66	-
14	红利再投	2022-01-17	153,991.54	153,991.54	-
15	申赎	2022-01-18	5,000,000.00	5,000,000.00	-
16	红利再投	2022-01-18	93,921.03	93,921.03	-
17	红利再投	2022-01-19	57,375.51	57,375.51	-
18	申赎	2022-01-19	5,000,000.00	5,000,000.00	-
19	申赎	2022-01-20	5,000,000.00	5,000,000.00	-
20	红利再投	2022-01-20	51,599.68	51,599.68	-
21	申赎	2022-01-21	5,000,000.00	5,000,000.00	-
22	红利再投	2022-01-21	54,950.06	54,950.06	-
23	红利再投	2022-01-24	178,121.79	178,121.79	-
24	红利再投	2022-01-25	99,820.98	99,820.98	-
25	红利再投	2022-01-26	54,771.42	54,771.42	-
26	红利再投	2022-01-27	55,169.53	55,169.53	-
27	红利再投	2022-01-28	55,062.40	55,062.40	-
28	红利再投	2022-02-07	546,189.74	546,189.74	-
29	红利再投	2022-02-08	54,397.35	54,397.35	-
30	红利再投	2022-02-09	53,383.83	53,383.83	-
31	红利再投	2022-02-10	52,008.58	52,008.58	-
32	申赎	2022-02-10	5,000,000.00	5,000,000.00	-
33	红利再投	2022-02-11	51,912.37	51,912.37	-
34	红利再投	2022-02-14	155,469.12	155,469.12	-
35	红利再投	2022-02-15	53,347.81	53,347.81	-
36	红利再投	2022-02-16	53,597.12	53,597.12	-
37	申赎	2022-02-16	5,000,000.00	5,000,000.00	-
38	红利再投	2022-02-17	50,810.76	50,810.76	-
39	申赎	2022-02-17	5,000,000.00	5,000,000.00	-
40	红利再投	2022-02-18	50,304.51	50,304.51	-

41	红利再投	2022-02-21	155,901.95	155,901.95	-
42	红利再投	2022-02-22	50,445.03	50,445.03	-
43	红利再投	2022-02-23	51,088.80	51,088.80	-
44	红利再投	2022-02-24	50,791.65	50,791.65	-
45	红利再投	2022-02-25	51,727.37	51,727.37	-
46	红利再投	2022-02-28	155,533.38	155,533.38	-
47	红利再投	2022-03-01	51,738.00	51,738.00	-
48	红利再投	2022-03-02	51,831.48	51,831.48	-
49	红利再投	2022-03-03	51,470.73	51,470.73	-
50	红利再投	2022-03-04	50,318.38	50,318.38	-
51	申赎	2022-03-04	5,000,000.00	5,000,000.00	-
52	红利再投	2022-03-07	149,640.14	149,640.14	-
53	红利再投	2022-03-08	50,833.08	50,833.08	-
54	红利再投	2022-03-09	50,538.80	50,538.80	-
55	申赎	2022-03-09	5,000,000.00	5,000,000.00	-
56	申赎	2022-03-10	5,000,000.00	5,000,000.00	-
57	红利再投	2022-03-10	50,836.26	50,836.26	-
58	红利再投	2022-03-11	50,746.14	50,746.14	-
59	红利再投	2022-03-14	153,572.67	153,572.67	-
60	红利再投	2022-03-15	53,309.64	53,309.64	-
61	红利再投	2022-03-16	51,622.91	51,622.91	-
62	红利再投	2022-03-17	51,206.03	51,206.03	-
63	红利再投	2022-03-18	51,408.62	51,408.62	-
64	红利再投	2022-03-21	156,061.54	156,061.54	-
65	红利再投	2022-03-22	51,411.89	51,411.89	-
66	红利再投	2022-03-23	52,100.23	52,100.23	-
67	红利再投	2022-03-24	52,208.35	52,208.35	-
68	红利再投	2022-03-25	52,974.42	52,974.42	-

69	申赎	2022-03-25	22,000,000.00	-22,000,000.00	-
70	红利再投	2022-03-28	155,600.34	155,600.34	-
71	红利再投	2022-03-29	52,320.12	52,320.12	-
72	申赎	2022-03-30	14,000,000.00	-14,000,000.00	-
73	红利再投	2022-03-30	53,757.44	53,757.44	-
74	红利再投	2022-03-31	52,736.75	52,736.75	-
合计			110,899,361.83	38,899,361.83	

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
2022 年 4 月 22 日