

# 景顺长城货币市场证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 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：2022 年 10 月 26 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 10 月 25 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 07 月 01 日起至 2022 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	37,572,237,743.14 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	36,989,503,663.42 份	582,734,079.72 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（2022 年 7 月 1 日-2022 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	149,662,272.49	2,628,040.43
2. 本期利润	149,662,272.49	2,628,040.43
3. 期末基金资产净值	36,989,503,663.42	582,734,079.72

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币基金的债券投资采用实际利率计算账面价值；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。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	0.3972%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.0569%	0.0010%
过去六个月	0.8523%	0.0009%	0.6768%	0.0000%	0.1755%	0.0009%
过去一年	1.9091%	0.0010%	1.3500%	0.0000%	0.5591%	0.0010%
过去三年	6.4113%	0.0013%	4.0500%	0.0000%	2.3613%	0.0013%

过去五年	12.7368%	0.0026%	6.7500%	0.0000%	5.9868%	0.0026%
自基金合同生效起至今	56.0054%	0.0058%	29.1960%	0.0019%	26.8094%	0.0039%

## 景顺长城货币 B

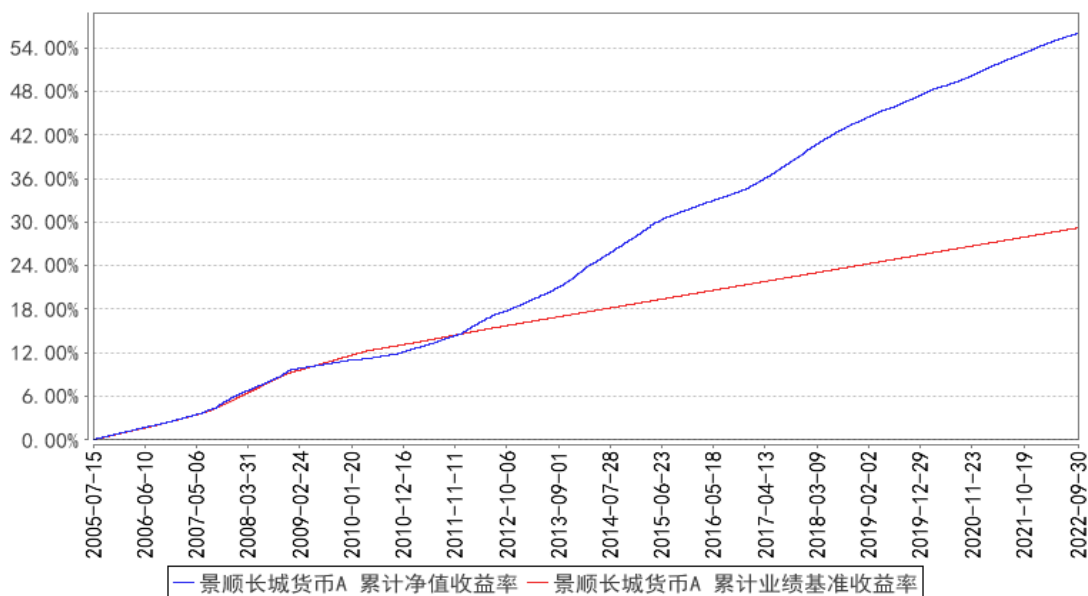
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.4580%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.1177%	0.0010%
过去六个月	0.9738%	0.0009%	0.6768%	0.0000%	0.2970%	0.0009%
过去一年	2.1540%	0.0010%	1.3500%	0.0000%	0.8040%	0.0010%
过去三年	7.1785%	0.0013%	4.0500%	0.0000%	3.1285%	0.0013%
过去五年	14.0930%	0.0026%	6.7500%	0.0000%	7.3430%	0.0026%
自基金合同生效起至今	44.5227%	0.0052%	16.9470%	0.0001%	27.5757%	0.0051%

注：1、本基金自 2010 年 4 月 30 日起实行份额分级；

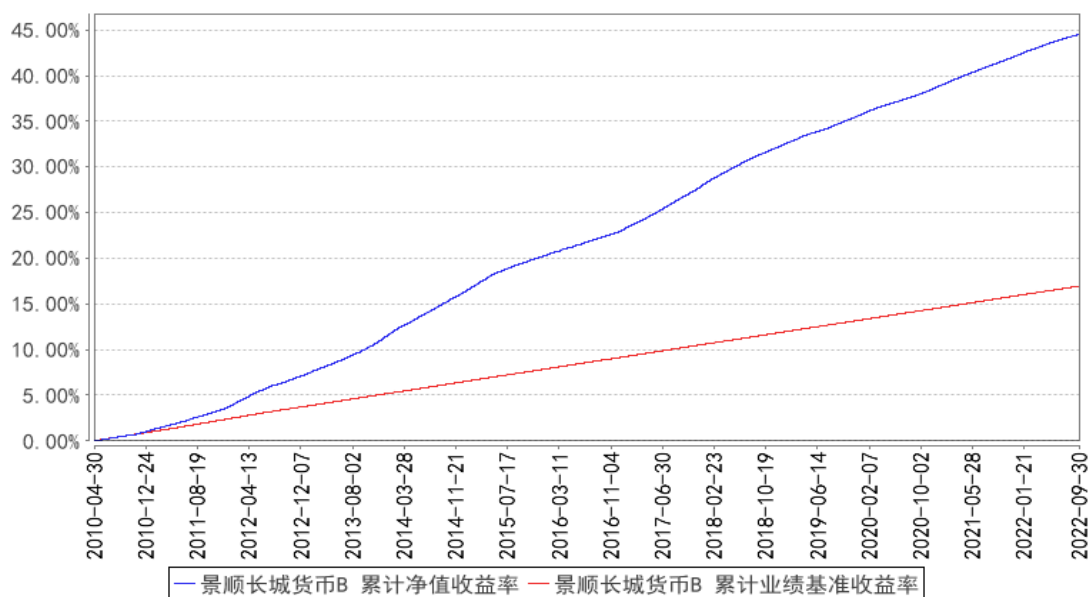
2、自 2019 年 6 月 17 日起本基金的收益分配方式由每日分配，按月结转份额改为每日分配，按日结转份额。

### 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合规守信情况说明

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 8 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

三季度海内外宏观环境非常复杂，海外主要经济体处于加息周期，我国货币政策在多目标下抉择，政策重点仍然是“以我为主”，保持了稳健偏宽的政策态度。价格方面，8月中调降政策利率一次，货币市场利率持续走低，数量上市场流动性较二季度收敛，但整体仍然保持合理充裕。具体来看央行货币政策操作，数量型调控上，7月以来央行调整公开市场 100 亿常态化操作方式，更多考虑市场化，公开市场操作量更加灵活。同时在 MLF 操作上，由于 1Y MLF 利率已大幅高于市场 1Y NCD 利率，除 7 月到期 1000 亿等量续作外，8 月及 9 月各到期 6000 亿均缩量 2000 亿，体现市场化。从整体市场情况来看，银行间资金面整体从 8 月中后出现分化，银行水位降低明显，但非银水位依然充裕。价格方面，7 月、8 月隔夜加权利率月平均在 1.21-1.27% 位置，保持低位。价格型操作方面，8 月央行降低 MLF 利率 10bp，带动银行间货币市场利率继续下行。1Y NCD 从 7

月初 2.35%左右维持下行至 9 月底 2%。在信用资金利率 1.6%底的位置支撑下，1Y NCD 下行有底，期间 8 月资金宽松时点下至 1.87%。9 月以来 1Y NCD 收益率逐步抬升，回到 2%位置，但仍然低于 MLF 利率 75bp。

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。三季度，组合跟随市场收益率波动以及对央行货币政策的判断灵活调整久期，在货币政策相对友好的环境下，整体上处于中性偏长水平。配置上，组合采用杠铃结构，以短期逆回购搭配长期限资产为主，因 CD 和同业存款利差不大，增加了 CD 的配置比例，提高组合流动性并获得再配置机会。三季度，杠杆收益较高，因此杠杆水平大多时间处于偏高水平。

随着央行上缴利润以及财政留抵退税额度基本使用结束，补充流动性的主要手段仅剩央行公开市场操作和再贷款等结构性工具，四季度 MLF 到期 2 万亿左右，市场对于央行降准置换的预期较高，但实质上对流动性的贡献有限。预计四季度资金面将会较三季度进一步收敛，但在稳增长压力较大的阶段，央行确保流动性合理充裕前提下，资金面不会明显收紧。当前 Dr007 仍然处于政策利率之下，在海外主要经济体加息进程中，预计央行四季度进一步下调政策利率的概率较小，而随着资金收敛，预计中枢也会缓慢提升，但整体仍将维持在政策利率之下。受此影响，预计货币市场收益率也将小幅提升，同时随着明年初现金管理类理财将满足新规要求，对于长久期资产的需求也将减弱。考虑到当前一年期 NCD 收益率仍大幅低于 MLF 利率，银行面临流动性缺口以及监管指标压力时，吸收长期限主动负债的意愿增强，供需两方面影响可能对 NCD 收益率带来一定上行压力，预计四季度曲线可能小幅走陡。

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，精细化管理组合流动性。预计未来央行仍将会保持流动性合理充裕，组合将延续杠杆策略。考虑到当前资产收益率已处于阶段性低点，未来反弹压力较大，组合将维持一个相对安全的久期水平，减少长久期资产的风险暴露。配置上以回购和存款为主，针对曲线可能走陡的情况下采取子弹型结构。组合将合理安排资产到期，重点关注“双 11”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 3 季度，景顺长城货币 A 类净值收益率为 0.3972%，业绩比较基准收益率为 0.3403%。

2022 年 3 季度，景顺长城货币 B 类净值收益率为 0.4580%，业绩比较基准收益率为 0.3403%。

#### 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	18,206,598,906.04	46.14
	其中：债券	18,206,598,906.04	46.14
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	12,317,673,909.53	31.21
	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	8,918,518,845.14	22.60
4	其他资产	18,529,150.72	0.05
5	合计	39,461,320,811.43	100.00

注：银行存款和结算备付金合计中包含定期存款 8,870,595,497.29 元。2022 年 7 月 29 日本基金与证券资管产品开展买入返售业务，质押券的最新评级为 AAA（中债资信评级为 AA-），截至 8 月 5 日该笔业务已到期。

## 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	3.71	
	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	1,871,336,237.38	4.98
	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	86
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	86
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

### 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	37.44	4.98
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	17.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	5.66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	12.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	31.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.64	4.98

#### 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	99,828,556.84	0.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,014,650,142.00	5.36
	其中：政策性金融债	1,912,767,833.01	5.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,316,734,101.74	6.17
6	中期票据	30,524,751.45	0.08
7	同业存单	13,744,861,354.01	36.58
8	其他	-	-
9	合计	18,206,598,906.04	48.46
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	112284002	22 宁波银行 CD205	7,000,000	691,885,999.10	1.84
2	112105225	21 建设银行 CD225	5,000,000	499,027,899.65	1.33
3	112205008	22 建设银行 CD008	5,000,000	497,155,457.51	1.32
4	112212138	22 北京银行 CD138	5,000,000	495,608,155.28	1.32
5	112203096	22 农业银行 CD096	5,000,000	495,287,897.55	1.32

6	112110408	21 兴业银行 CD408	4,900,000	489,649,768.35	1.30
7	112203077	22 农业银行 CD077	4,500,000	444,483,651.26	1.18
8	112212061	22 北京银行 CD061	4,000,000	399,014,806.31	1.06
9	220201	22 国开 01	3,900,000	396,242,067.53	1.05
10	210411	21 农发 11	3,000,000	306,258,667.90	0.82

### 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	0.0693%
报告期内偏离度的最低值	0.0097%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0461%

#### 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

货币基金的债券投资采用实际利率计算账面价值；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。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

宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”，股票代码：002142）于 2022 年 9 月 8 日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（2022）60 号）。其因柜面业务内控管理不到位，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条规定，被处以罚款人民币 25 万元。

2022 年 5 月 27 日，宁波银行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（2022）44 号）。其因非标投资业务管理不审慎、理财业务管理不规范、主承销债券管控不到位等，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条规定，被处以罚款人民币 290 万元。

2022 年 4 月 21 日，宁波银行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（2022）35 号）。其因薪酬管理不到位、关联交易管理不规范、绿色信贷政策执行不到位等，违

反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条规定，被处以罚款人民币 270 万元。

2022 年 4 月 11 日，宁波银行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(2022) 28 号)。其因信贷资金违规流入房地产领域、违规向土地储备项目提供融资等，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条规定，被处以罚款人民币 220 万元。同日，宁波银行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(2022) 30 号)。其因代理保险销售不规范，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，被处以罚款人民币 30 万元。

2021 年 12 月 29 日，宁波银行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。

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。

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 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) 14 号)，其因贸易融资业务 EAST 数据存在偏差、贷款核销业务 EAST 数据存在偏差等多项违法违规行为，被处以罚款人民币 470 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。

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。

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 2021 年 12 月 8 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(2021) 38 号)。其因制定文件要求企业对公账户必须开通属于该行收费项目的动账短信通知服务，侵害客户

自主选择权等问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，被处以罚款 150 万元。

农业银行于 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)12 号)。其因漏报贷款核销业务 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据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，被处以罚款 480 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农业银行进行了投资。

兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码：601166）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。

国家开发银行于 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)8 号)。其因未报送逾期 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，被处以罚款 440 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。

2022 年 3 月 21 日，中国农业发展银行（以下简称“农发行”）因漏报不良贷款余额 EAST 数据、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差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，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)10 号），被处以罚款 480 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农发行进行了投资。

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	438,191.76
3	应收利息	-
4	应收申购款	18,090,558.96
5	其他应收款	400.00
6	其他	-
7	合计	18,529,150.72

#### 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	38,113,560,978.16	514,449,724.87
报告期期间基金总申购份额	87,817,919,348.67	286,901,801.52
报告期期间基金总赎回份额	88,941,976,663.41	218,617,446.67
报告期期末基金份额总额	36,989,503,663.42	582,734,079.72

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	2022-07-01	23,507.56	23,507.56	-
2	红利再投	2022-07-04	72,975.07	72,975.07	-
3	红利再投	2022-07-05	24,536.75	24,536.75	-
4	申赎	2022-07-05	5,000,000.00	5,000,000.00	-
5	红利再投	2022-07-06	24,364.91	24,364.91	-
6	申赎	2022-07-06	5,000,000.00	5,000,000.00	-
7	红利再投	2022-07-07	24,609.86	24,609.86	-
8	红利再投	2022-07-08	24,455.49	24,455.49	-
9	红利再投	2022-07-11	73,095.53	73,095.53	-
10	红利再投	2022-07-12	29,404.30	29,404.30	-
11	申赎	2022-07-12	5,000,000.00	5,000,000.00	-
12	红利再投	2022-07-13	24,687.55	24,687.55	-

13	红利再投	2022-07-14	24,306.20	24,306.20	-
14	申赎	2022-07-14	5,000,000.00	5,000,000.00	-
15	红利再投	2022-07-15	24,362.63	24,362.63	-
16	申赎	2022-07-15	5,000,000.00	5,000,000.00	-
17	红利再投	2022-07-18	77,034.56	77,034.56	-
18	申赎	2022-07-18	5,000,000.00	5,000,000.00	-
19	红利再投	2022-07-19	29,174.97	29,174.97	-
20	红利再投	2022-07-20	31,362.67	31,362.67	-
21	申赎	2022-07-20	5,000,000.00	5,000,000.00	-
22	红利再投	2022-07-21	30,772.14	30,772.14	-
23	申赎	2022-07-21	5,000,000.00	5,000,000.00	-
24	红利再投	2022-07-22	29,929.35	29,929.35	-
25	申赎	2022-07-22	5,000,000.00	5,000,000.00	-
26	红利再投	2022-07-25	83,475.20	83,475.20	-
27	申赎	2022-07-25	5,000,000.00	5,000,000.00	-
28	红利再投	2022-07-26	25,160.47	25,160.47	-
29	申赎	2022-07-26	5,000,000.00	5,000,000.00	-
30	红利再投	2022-07-27	24,764.05	24,764.05	-
31	申赎	2022-07-27	5,000,000.00	5,000,000.00	-
32	红利再投	2022-07-28	24,845.95	24,845.95	-
33	申赎	2022-07-28	5,000,000.00	5,000,000.00	-
34	红利再投	2022-07-29	25,191.98	25,191.98	-
35	申赎	2022-07-29	5,000,000.00	5,000,000.00	-
36	红利再投	2022-08-01	75,399.49	75,399.49	-
37	红利再投	2022-08-02	27,595.60	27,595.60	-
38	红利再投	2022-08-03	24,593.78	24,593.78	-
39	红利再投	2022-08-04	25,857.13	25,857.13	-
40	红利再投	2022-08-05	25,322.47	25,322.47	-

41	红利再投	2022-08-08	74,030.38	74,030.38	-
42	红利再投	2022-08-09	23,820.92	23,820.92	-
43	红利再投	2022-08-10	23,718.30	23,718.30	-
44	红利再投	2022-08-11	23,498.73	23,498.73	-
45	红利再投	2022-08-12	23,135.53	23,135.53	-
46	红利再投	2022-08-15	74,502.37	74,502.37	-
47	红利再投	2022-08-16	24,623.24	24,623.24	-
48	红利再投	2022-08-17	22,663.98	22,663.98	-
49	红利再投	2022-08-18	21,270.70	21,270.70	-
50	红利再投	2022-08-19	23,156.05	23,156.05	-
51	红利再投	2022-08-22	58,637.04	58,637.04	-
52	红利再投	2022-08-23	56,838.72	56,838.72	-
53	红利再投	2022-08-24	23,955.16	23,955.16	-
54	红利再投	2022-08-25	23,856.56	23,856.56	-
55	红利再投	2022-08-26	23,800.84	23,800.84	-
56	申赎	2022-08-26	8,000,000.00	-8,000,000.00	-
57	红利再投	2022-08-29	71,034.89	71,034.89	-
58	红利再投	2022-08-30	29,081.65	29,081.65	-
59	红利再投	2022-08-31	21,098.02	21,098.02	-
60	红利再投	2022-09-01	23,502.46	23,502.46	-
61	红利再投	2022-09-02	23,500.78	23,500.78	-
62	红利再投	2022-09-05	71,314.72	71,314.72	-
63	红利再投	2022-09-06	23,842.60	23,842.60	-
64	红利再投	2022-09-07	23,630.96	23,630.96	-
65	红利再投	2022-09-08	23,404.48	23,404.48	-
66	红利再投	2022-09-09	38,798.77	38,798.77	-
67	红利再投	2022-09-13	116,673.16	116,673.16	-
68	红利再投	2022-09-14	23,029.72	23,029.72	-

69	申赎	2022-09-14	5,000,000.00	5,000,000.00	-
70	红利再投	2022-09-15	23,058.08	23,058.08	-
71	红利再投	2022-09-16	23,008.71	23,008.71	-
72	红利再投	2022-09-19	68,848.84	68,848.84	-
73	红利再投	2022-09-20	22,703.59	22,703.59	-
74	红利再投	2022-09-21	20,903.70	20,903.70	-
75	红利再投	2022-09-22	23,187.84	23,187.84	-
76	红利再投	2022-09-23	23,310.33	23,310.33	-
77	红利再投	2022-09-26	71,654.42	71,654.42	-
78	红利再投	2022-09-27	38,819.90	38,819.90	-
79	红利再投	2022-09-28	24,237.53	24,237.53	-
80	红利再投	2022-09-29	25,657.95	25,657.95	-
81	红利再投	2022-09-30	21,542.09	21,542.09	-
合计			85,328,139.37	69,328,139.37	

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 10 月 26 日