

景顺长城货币市场证券投资基金 2024 年第 3 季度报告

2024 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：2024 年 10 月 25 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 2024 年 10 月 24 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 2024 年 7 月 1 日起至 2024 年 9 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	43,864,464,235.82 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	43,398,561,929.04 份	465,902,306.78 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（2024 年 7 月 1 日-2024 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	159,334,778.27	2,130,271.01
2. 本期利润	159,334,778.27	2,130,271.01
3. 期末基金资产净值	43,398,561,929.04	465,902,306.78

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	0.3674%	0.0006%	0.3393%	0.0000%	0.0281%	0.0006%
过去六个月	0.7816%	0.0006%	0.6750%	0.0000%	0.1066%	0.0006%
过去一年	1.7753%	0.0015%	1.3509%	0.0000%	0.4244%	0.0015%
过去三年	5.5958%	0.0012%	4.0509%	0.0000%	1.5449%	0.0012%
过去五年	10.2608%	0.0013%	6.7509%	0.0000%	3.5099%	0.0013%
自基金合同 生效起至今	61.6490%	0.0055%	31.8969%	0.0018%	29.7521%	0.0037%

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	0.4279%	0.0006%	0.3393%	0.0000%	0.0886%	0.0006%
过去六个月	0.9023%	0.0006%	0.6750%	0.0000%	0.2273%	0.0006%
过去一年	2.0196%	0.0015%	1.3509%	0.0000%	0.6687%	0.0015%
过去三年	6.3585%	0.0012%	4.0509%	0.0000%	2.3076%	0.0012%
过去五年	11.5898%	0.0013%	6.7509%	0.0000%	4.8389%	0.0013%

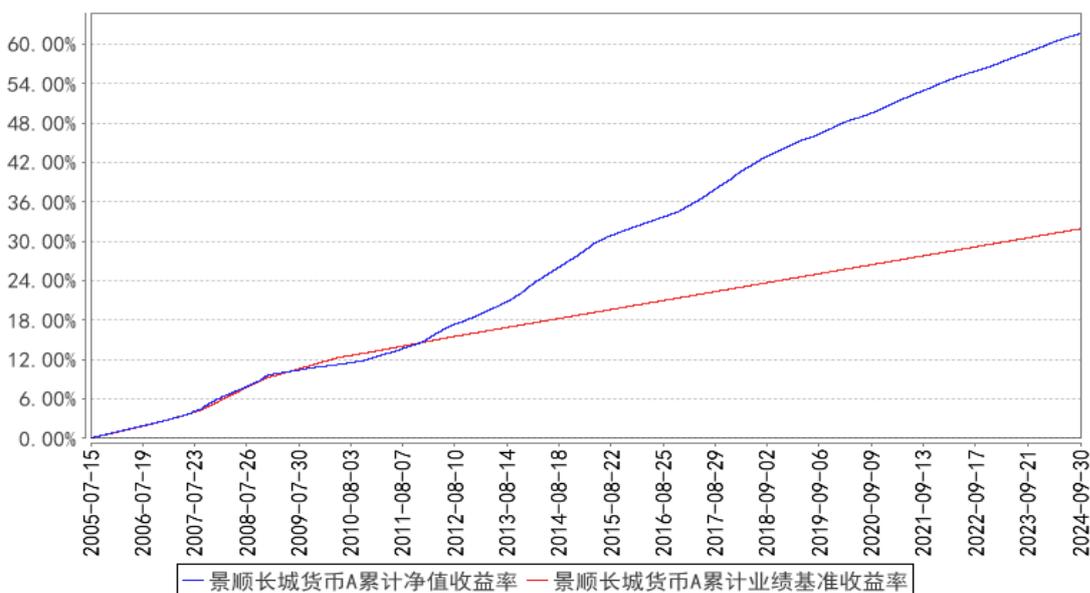
自基金合同生效起至今	50.4711%	0.0049%	19.6480%	0.0001%	30.8231%	0.0048%
------------	----------	---------	----------	---------	----------	---------

注：1、本基金自 2010 年 4 月 30 日起实行份额分级；

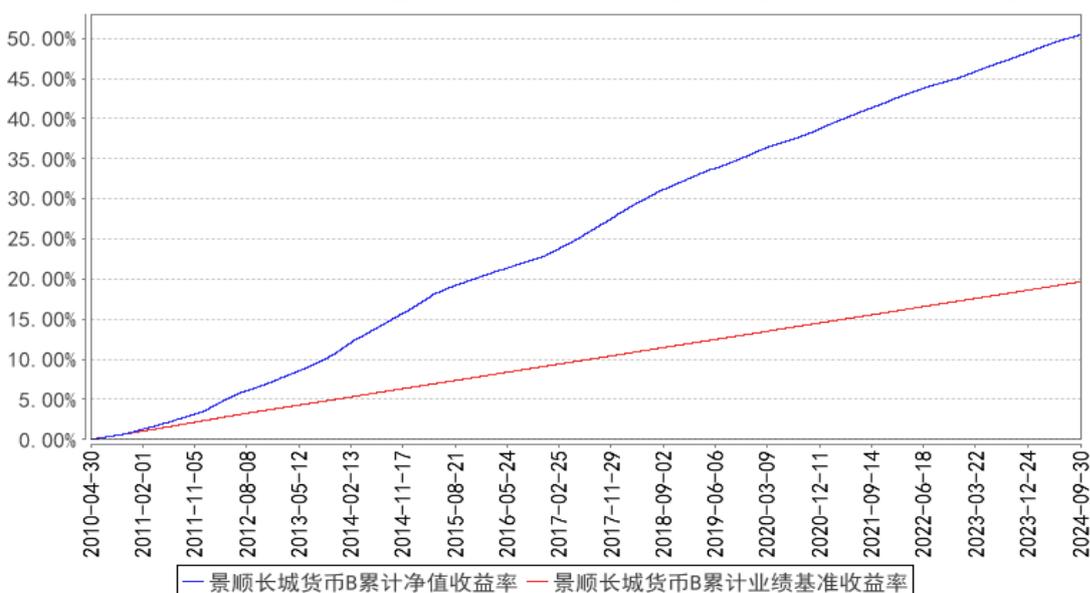
2、自 2019 年 6 月 17 日起本基金的收益分配方式由每日分配，按月结转份额改为每日分配，按日结转份额。

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	-	13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13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	-	10年	经济学硕士，CFA。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10年证券、基金行业从业经验。
黄惠伶	本基金的基金助理	2022年11月9日	-	6年	管理学硕士。2018年7月加入本公司，历任交易管理部交易员、固定收益部研究员。现任固定收益部基金经理助理。具有6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 14 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要而发生的同日反向交易。

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

三季度前两个月经济延续二季度继续下行，制造业 PMI 在三季度前两个月进一步走低，8 月回落至 49.1，9 月止跌回升至 49.8，连续 5 个月下行后企稳回升。虽然 7 月广义财政发力重回扩张区间，但财政资金的使用效率在下降，8 月广义财政支出再次下行，基建增速随之下行至 1.2%。8 月社会消费品零售总额同比增速从前值 2.7% 回落至 2.1%，季调环比增速再次负增长，环比下跌 0.01%，指向居民消费下行，与核心 CPI 环比增速节奏一致。8 月限额以上社零延续负增长，同比下跌了 0.6%，为非疫情扰动月份连续负增长。三季度以来消费者信心指数和就业预期指数继续下行，叠加收入增速下降，消费整体走弱。在“努力实现全年经济社会发展目标”的定调下，货币政策加大发力，“924”新政推出一系列货币金融政策组合拳，超市场预期，凸显政策层稳经济稳市场和提振微观主体信心的决心。“926”政治局会议罕见讨论经济议题，会议强调“加大财政货币政策逆周期调节力度”的同时，就地产、消费等领域做出了积极表态，地产层面出现“促进房地产市场止跌回稳”的新表述。本次会议对于提振经济预期和增强资本市场信心均具有积极的信号作用，后续需重点关注增量财政政策力度以及财政发力方向，财政最终的落地情况是经济基本面能否扎实企稳回升的关键。

三季度，央行货币政策保持积极，罕见的在一个季度内两次降息，在多种货币政策工具配合下资金面相对平稳，但资金中枢仍保持高位。7 月下旬，央行主动调降 OMO 政策利率 10BP，同时将逆回购操作调整为数量招标，从后续运行状况来看，公开市场基本上满足了金融机构的每日需求，在月末、税期以及政府债缴款较为集中的时点上，投放大量逆回购以平抑资金波动。因银行体系的长期限稳定资金仍相对稀缺，OMO 余额较高对银行间流动性预期造成一定扰动，波动加大，而资金价格也始终处于高位。从价格角度来看，DR007 月均值分别为 1.83%、1.79% 和 1.79%，资金中枢仍处于政策利率之上，与调降前未有明显下行。同时央行于 7 月初公告将视情况开展临时

隔夜正逆回购操作，操作利率分别为 7 天期逆回购操作利率减点 20BP 和加点 50BP，这在一定程度上也是对现有利率走廊的优化，因此三季度隔夜价格基本在 1.5%~2.2% 区间波动。9 月底国新办举行新闻发布会上，潘功胜行长预告了年底前的货币政策工具，同时政治局会议后，货币政策迅速落地，包括 9 月 27 日当天降准 50BP，MLF 利率和 OMO 利先后调降至 2.0% 和 1.5%，预计降存贷款利率以及存量房贷利率也在路上。

7 月份开始，为弱化 MLF 作为政策利率的色彩，央行将 MLF 操作调整到每月 25 日，在 LPR 公告之后。四季度 MLF 面临大量到期，央行也逐步将债券买卖作为基础货币投放的途径之一。从央行月末公告来看，三季度央行通过向部分公开市场业务一级交易商买入短期国债并卖出长期国债，全季净买入债券面值为 3000 亿元。

NCD 在 7 月份跟随 OMO 降息有所下行，8 月份受到理财赎回影响，收益率有所反弹，之后因资金中枢始终保持高位，1 年期国股行 NCD 基本围绕 1.95% 中枢震荡。季末前因 OMO 和 MLF 利率大幅下行，震荡中枢下行至 1.85% 附近，之后跟随债市调整有所反弹。至季末时点 3 个月和 1 年期 AAA 评级 NCD 收益率分别收于 1.87% 和 1.91%，较二季末分别变动 +7BP 和 -6BP，曲线有所走平。

现券方面，市场呈现结构性行情，长短端受多方面因素影响，定价逻辑有所分化，收益率整体上延续下行趋势，但在季末前触及历史低点后快速反弹。三季度，基本面数据仍在磨底，内需不足外需较强的特征没有改变，禁止手工补息和存款利率调降使得出表进程延续，从而加剧“资产荒”问题，整体对债市构成支撑。随着降息、降存贷款利率等政策落地，利率中枢的下行使得收益率曲线也处于下行通道中，但因央行从 4 月份开始关注并多次指导长债、超长债的过快下行，长端曲线受扰动较大，这一特点在三季度得以延续。7 月初央行公告面向部分公开市场业务一级交易商开展国债借入操作，带来长债的大幅上行。8 月 7 日交易商协会公告对涉嫌操纵市场价格、利益输送的四家机构启动自律调查，强监管带来债市收益率有所反弹，直至 8 月 21 日，交易商协会副秘书长徐忠针对“当前债市存在三个认识误区”发文，情绪稍微修复。但 8 月开始，大行在二级市场上卖出 7-10 年国债，债市始终受到牵制，利率债整体维持窄幅震荡，同时成交量从高位明显回落，债券流动性受到抑制，并带来信用债的调整，局部出现一定程度的负反馈，信用利差有所修复。9 月中上旬，市场逐步从 8 月信用债赎回的阴影中企稳，对大行卖债行为也有所钝化，同时受流动性转松、存量房贷利率下调预期渐浓、基本面数据仍偏弱等多重利好带动下，以及人大常委会并未调整当年赤字这一潜在利空的解除，整体收益率曲线呈现单边下行走势。24 日，国新办新闻发布会上潘行长提前预告了年内降准降息以及降低存量房贷利率等货币政策操作，随后政治局会议上对托底经济的定调积极，权益市场快速走强，债市走出利好出尽行情，且在风险偏好带动下收益率快速上行。

对于中短端曲线，定价逻辑除跟随长债外，本身还受到资金面和大行行为的影响，下行幅度更大。随着央行将 OMO 操作改为数量招标，以及增加临时正逆回购工具，资金面确定性加强，短端相对收益。8 月份，大行在卖出长债的同时，也加大了 3 年内国债的买入力量，大行行为持续至 9 月中旬，从而带动 3 年内国债从高点下行超 30BP，并与资金利率倒挂。截至三季度末，1 年、3 年、5 年、10 年、30 年国债收益率分别收于 1.37%、1.56%、1.84%、2.15% 和 2.36%，较季度初分别下行 20BP、27BP、18BP、10BP 和 12BP，整体上曲线呈现陡峭化下行。

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。三季度整体上对债市相对乐观，因此组合剩余期限基本维持高位，多数时间保持在 85 天以上的水平。考虑到各项指标约束、期限利差和资本利得，配置上多以跨年品种为主，存款存单占比始终处于较高水平。因资金价格中枢维持高位，杠杆收益不明显，因此组合杠杆水平平均保持在偏低水平，季末前逆回购占比逐步提升。

9 月末的政治局会议对于维稳经济的定调较为积极，从已经出台的政策来看，仍然是货币先行，降准降息均已落地，年内存量房贷利率和 LPR 下调基本也已确定，并且按照政治局会议上提出的“实施有力度的降息”，不排除四季度仍存在降准降息的可能。国庆长假前，四个一线城市均公告了对于限购政策的优化，广州更是全面放开限购，对于房地产市场能否“止跌回稳”，还需要观察地产销售数据以及政策放松后效果的持续性。而对于经济能否企稳，也还需要观察配套政策的落地，特别是财政政策是否会加大力度。财政政策确认仍需要等待 10 月份人大会议，在此之前，风险偏好对债市始终有压制。即使配套政策超预期，地产投资、消费的企稳仍较为漫长，企业盈利修复也可能要等到明年才可以看到，但货币政策确定性较高，因此债市也不具备反转的基础。

经历三季末收益率大幅反弹后，债市已经进入配置区间，无论从降息后的债券定价、贷款债券比价效应、期限利差或是未来货币政策空间的角度来看，长债、超长债继续上行的空间有限，当前已经出现较高赔率。降准降息落地后，资金面宽松是大概率事件，同时资金中枢也将跟随 OMO 利率调降而下降，中短端确定性更大。短期需要重点关注股市赚钱效应带来的理财赎回问题，可能会放大市场波动，但对于长债也增加了波段交易的机会。关注权益市场上涨动能减弱后长端的交易机会，以及大行可能的买入长债带来的收益率见顶信号。

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。四季度，预计资金面中枢将整体下移，流动性预期好转，考虑到年内降准降息的可能，组合将维持偏长久期。配置上主要以回购和流动性较好的 NCD 为主，小仓位利用长久期资产开展波段操作。组合将密切关注权益市场波动、跨季后理财端负债的稳定性以及财政政

策对市场流动性的影响，灵活调整久期和杠杆，提前预判并及时调整投资策略。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2024 年 3 季度，景顺长城货币 A 类净值收益率为 0.3674%，业绩比较基准收益率为 0.3393%。

2024 年 3 季度，景顺长城货币 B 类净值收益率为 0.4279%，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	16,959,253,753.54	36.88
	其中：债券	16,959,253,753.54	36.88
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	12,227,240,642.73	26.59
	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	16,763,645,764.89	36.46
4	其他资产	34,317,815.88	0.07
5	合计	45,984,457,977.04	100.00

注：银行存款和结算备付金合计中包含定期存款 16,748,123,801.05 元。

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	3.57	
	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	2,098,623,668.92	4.78
	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	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	80

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	31.27	4.78
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	13.24	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	15.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	14.24	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	30.45	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.33	4.78

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,964,046,568.81	9.04
	其中：政策性金融债	2,258,385,152.41	5.15
4	企业债券	386,346,994.57	0.88
5	企业短期融资券	606,060,049.84	1.38
6	中期票据	430,098,500.84	0.98
7	同业存单	11,572,701,639.48	26.38
8	其他	-	-
9	合计	16,959,253,753.54	38.66
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	200203	20 国开 03	8,000,000	821,886,963.56	1.87
2	112416125	24 上海银行 CD125	6,000,000	596,874,831.54	1.36
3	112492734	24 南京银行 CD028	4,000,000	398,714,587.05	0.91
4	112405145	24 建设银行 CD145	4,000,000	396,993,612.79	0.91
5	112486995	24 宁波银行 CD138	4,000,000	396,239,115.73	0.90
6	240301	24 进出 01	3,600,000	365,253,391.50	0.83
7	2128035	21 华夏银行 02	3,500,000	358,372,869.95	0.82
8	112414043	24 江苏银行 CD043	3,500,000	346,871,271.99	0.79
9	2228007	22 浦发银行 01	3,200,000	325,715,688.62	0.74
10	240401	24 农发 01	3,100,000	313,262,204.33	0.71

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	0.0506%
报告期内偏离度的最低值	0.0241%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0362%

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

上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局等的处罚。

南京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

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述主体所发行证券进行了投资。本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内未出现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	34,317,815.88
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	34,317,815.88

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	43,762,087,705.10	372,586,607.30
报告期期间基金总申购份额	78,864,792,747.84	1,395,334,821.67
报告期期间基金总赎回份额	79,228,318,523.90	1,302,019,122.19
报告期期末基金份额总额	43,398,561,929.04	465,902,306.78

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	2024-07-01	32,693.44	32,693.44	-
2	红利再投	2024-07-02	10,744.91	10,744.91	-
3	红利再投	2024-07-03	11,831.48	11,831.48	-
4	红利再投	2024-07-04	10,566.01	10,566.01	-
5	申赎	2024-07-04	5,000,000.00	5,000,000.00	-

6	红利再投	2024-07-05	10,622.17	10,622.17	-
7	红利再投	2024-07-08	31,499.99	31,499.99	-
8	红利再投	2024-07-09	10,395.56	10,395.56	-
9	红利再投	2024-07-10	10,160.07	10,160.07	-
10	申赎	2024-07-10	5,000,000.00	5,000,000.00	-
11	红利再投	2024-07-11	10,445.24	10,445.24	-
12	红利再投	2024-07-12	10,797.04	10,797.04	-
13	申赎	2024-07-12	5,000,000.00	5,000,000.00	-
14	红利再投	2024-07-15	32,519.30	32,519.30	-
15	红利再投	2024-07-16	10,697.71	10,697.71	-
16	红利再投	2024-07-17	10,644.84	10,644.84	-
17	红利再投	2024-07-18	13,940.23	13,940.23	-
18	红利再投	2024-07-19	10,791.36	10,791.36	-
19	申赎	2024-07-19	5,000,000.00	5,000,000.00	-
20	红利再投	2024-07-22	33,015.19	33,015.19	-
21	红利再投	2024-07-23	10,886.27	10,886.27	-
22	红利再投	2024-07-24	10,843.34	10,843.34	-
23	红利再投	2024-07-25	11,709.36	11,709.36	-
24	红利再投	2024-07-26	11,000.52	11,000.52	-
25	申赎	2024-07-26	5,000,000.00	5,000,000.00	-
26	红利再投	2024-07-29	33,784.19	33,784.19	-
27	红利再投	2024-07-30	11,656.09	11,656.09	-
28	红利再投	2024-07-31	11,172.90	11,172.90	-
29	红利再投	2024-08-01	11,846.46	11,846.46	-
30	红利再投	2024-08-02	10,827.25	10,827.25	-
31	红利再投	2024-08-05	33,478.81	33,478.81	-
32	红利再投	2024-08-06	12,768.44	12,768.44	-
33	申赎	2024-08-06	5,000,000.00	5,000,000.00	-
34	红利再投	2024-08-07	10,843.12	10,843.12	-
35	申赎	2024-08-07	5,000,000.00	5,000,000.00	-
36	红利再投	2024-08-08	11,840.53	11,840.53	-
37	申赎	2024-08-08	5,000,000.00	5,000,000.00	-
38	红利再投	2024-08-09	11,159.98	11,159.98	-
39	申赎	2024-08-09	5,000,000.00	5,000,000.00	-
40	红利再投	2024-08-12	35,103.30	35,103.30	-
41	红利再投	2024-08-13	11,060.37	11,060.37	-
42	申赎	2024-08-13	5,000,000.00	5,000,000.00	-
43	红利再投	2024-08-14	12,121.81	12,121.81	-
44	申赎	2024-08-14	5,000,000.00	5,000,000.00	-
45	红利再投	2024-08-15	12,913.98	12,913.98	-
46	申赎	2024-08-15	5,000,000.00	5,000,000.00	-
47	红利再投	2024-08-16	12,413.08	12,413.08	-

48	申赎	2024-08-16	5,000,000.00	5,000,000.00	-
49	红利再投	2024-08-19	37,762.15	37,762.15	-
50	红利再投	2024-08-20	14,300.43	14,300.43	-
51	申赎	2024-08-20	5,000,000.00	5,000,000.00	-
52	红利再投	2024-08-21	12,890.00	12,890.00	-
53	红利再投	2024-08-22	12,179.95	12,179.95	-
54	红利再投	2024-08-23	11,433.10	11,433.10	-
55	红利再投	2024-08-26	35,777.40	35,777.40	-
56	红利再投	2024-08-27	15,463.97	15,463.97	-
57	红利再投	2024-08-28	17,901.07	17,901.07	-
58	红利再投	2024-08-29	10,924.89	10,924.89	-
59	红利再投	2024-08-30	12,440.23	12,440.23	-
60	申赎	2024-08-30	5,000,000.00	5,000,000.00	-
61	红利再投	2024-09-02	36,925.22	36,925.22	-
62	红利再投	2024-09-03	16,694.93	16,694.93	-
63	红利再投	2024-09-04	17,126.67	17,126.67	-
64	红利再投	2024-09-05	12,778.74	12,778.74	-
65	申赎	2024-09-05	5,000,000.00	5,000,000.00	-
66	红利再投	2024-09-06	12,854.33	12,854.33	-
67	申赎	2024-09-06	5,000,000.00	5,000,000.00	-
68	红利再投	2024-09-09	52,782.33	52,782.33	-
69	红利再投	2024-09-10	13,617.30	13,617.30	-
70	申赎	2024-09-10	5,000,000.00	5,000,000.00	-
71	红利再投	2024-09-11	13,794.79	13,794.79	-
72	申赎	2024-09-11	5,000,000.00	5,000,000.00	-
73	红利再投	2024-09-12	14,197.80	14,197.80	-
74	申赎	2024-09-12	5,000,000.00	5,000,000.00	-
75	红利再投	2024-09-13	14,255.38	14,255.38	-
76	申赎	2024-09-13	5,000,000.00	5,000,000.00	-
77	红利再投	2024-09-18	75,898.21	75,898.21	-
78	红利再投	2024-09-19	14,410.70	14,410.70	-
79	红利再投	2024-09-20	14,694.72	14,694.72	-
80	红利再投	2024-09-23	47,043.42	47,043.42	-
81	红利再投	2024-09-24	14,780.21	14,780.21	-
82	红利再投	2024-09-25	13,974.91	13,974.91	-
83	申赎	2024-09-25	5,000,000.00	5,000,000.00	-
84	红利再投	2024-09-26	15,411.49	15,411.49	-
85	申赎	2024-09-26	5,000,000.00	5,000,000.00	-
86	红利再投	2024-09-27	14,845.17	14,845.17	-
87	红利再投	2024-09-30	49,780.25	49,780.25	-
合计			116,195,734.10	116,195,734.10	-

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
2024 年 10 月 25 日