

# 景顺长城货币市场证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 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

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

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 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 债券回购融资情况.....	39
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	39
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	40
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....	41

7.8 期末按实际利率计算的账面价值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.....	41
7.9 投资组合报告附注.....	41
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	44
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	47
10.9 其他重大事件.....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>48</b>
11.1 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.....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城货币市场证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	38,628,010,703.03 份	
基金合同存续期	不定期	
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	38,113,560,978.16 份	514,449,724.87 份

### 2.2 基金产品说明

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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	许俊
	联系电话	0755-82370388	95566

电子邮箱	investor@igwfm.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	4008888606	95566
传真	0755-22381339	010-66594942
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518048	100818
法定代表人	李进	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B
本期已实现收益	374,348,808.35	10,500,918.94
本期利润	374,348,808.35	10,500,918.94
本期净值收益率	0.9671%	1.0873%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	38,113,560,978.16	514,449,724.87
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	55.3882%	43.8638%

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、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 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	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.1385%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.0275%	0.0002%
过去三个月	0.4534%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.1168%	0.0007%
过去六个月	0.9671%	0.0009%	0.6695%	0.0000%	0.2976%	0.0009%
过去一年	2.0311%	0.0007%	1.3500%	0.0000%	0.6811%	0.0007%
过去三年	6.6064%	0.0018%	4.0500%	0.0000%	2.5564%	0.0018%
自基金合同生效起至今	55.3882%	0.0058%	28.8557%	0.0019%	26.5325%	0.0039%

景顺长城货币 B

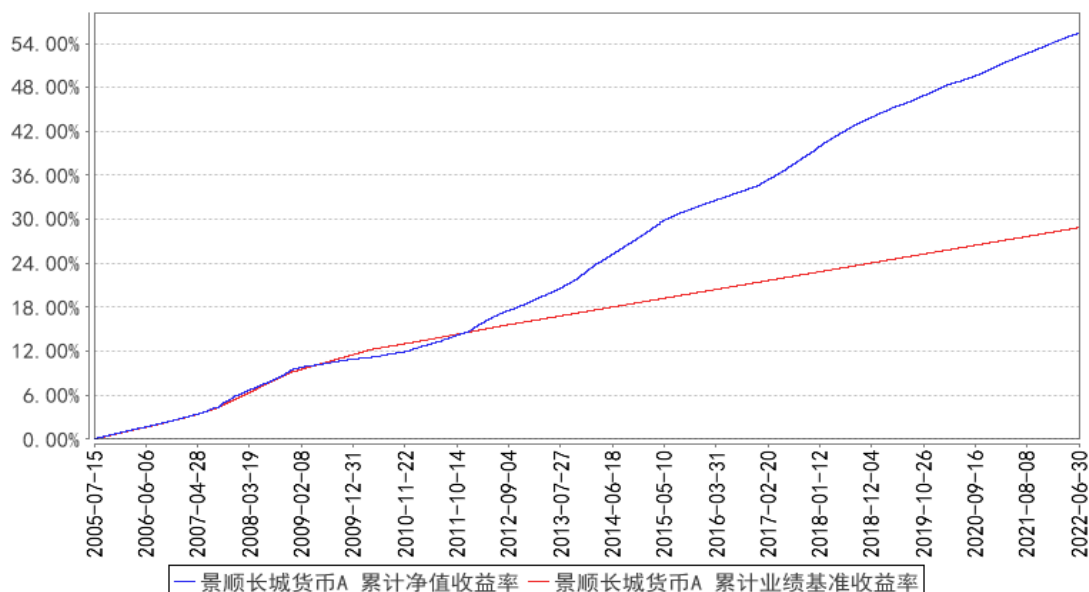
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1582%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.0472%	0.0002%
过去三个月	0.5135%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.1769%	0.0007%
过去六个月	1.0873%	0.0009%	0.6695%	0.0000%	0.4178%	0.0009%
过去一年	2.2762%	0.0007%	1.3500%	0.0000%	0.9262%	0.0007%
过去三年	7.3735%	0.0018%	4.0500%	0.0000%	3.3235%	0.0018%
自基金合同生效起至今	43.8638%	0.0052%	16.6068%	0.0001%	27.2570%	0.0051%

注：1、本基金自 2010 年 4 月 30 日起实行份额分级；

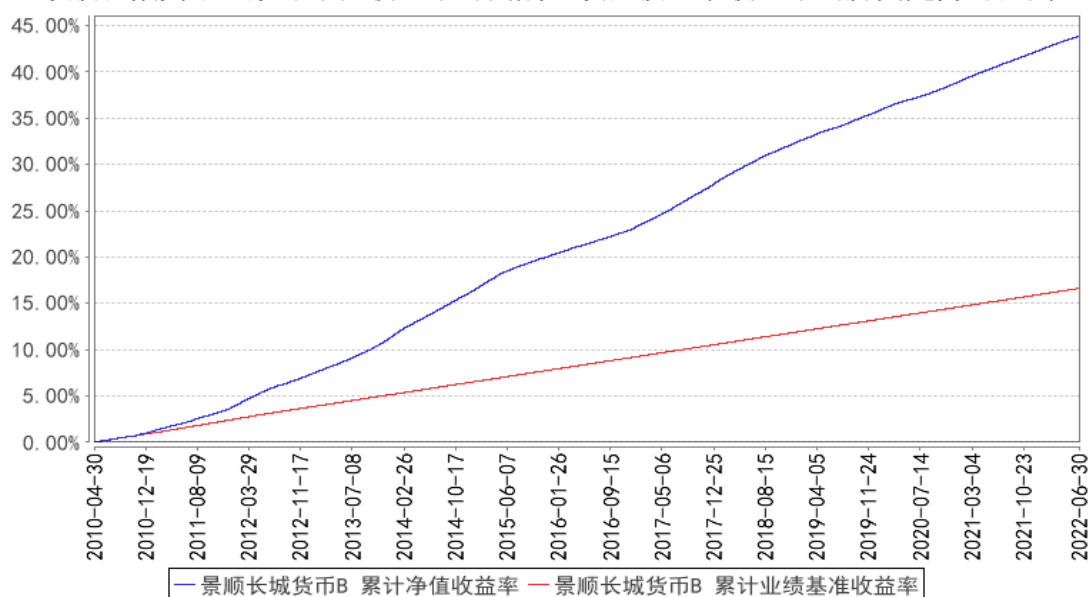
2、自 2019 年 6 月 17 日起本基金的收益分配方式由每日分配，按月结转份额改为每日分配，按日结转份额。

### 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。

### 3.3 其他指标

无。



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2022年6月30日，本公司旗下共管理150只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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”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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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 27 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金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。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 MLF 超额续作 1000 亿，3 月虽然降准降息等大幅宽松政策落空，但央行仍延续公开市场投放呵护流动性，机构平稳跨季。二季度由于上海疫情大幅超预期，全国出现散点疫情反复，各地人流物流受限、消费场景等均受到了扼制，对经济造成了一定幅度的冲击，因此央行进入危机应对模式。对比包商事件和永煤事件后，央行此次仍然在流动性投放上加大力度，4 月 15 日央行下调金融机构存款准备金率 0.25 个百分点，区别于以往 0.5 个百分点，本次降准释放长期流动性 5300 亿左右；另一方面央行通过上缴结存利润、投放再贷款等方式持续向市场投放流动性。

但受到外围主要经济体加息周期影响，在具体政策操作工具上的选择上无论是总量工具使用亦或是政策利率方面还是较为谨慎。

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%。二季度，虽然政策利率保持不变，但市场利率大幅低于政策利率，其中 R001 均值仅为 1.51%，DR007 的均值也仅为 1.72%。银行间流动性极为充裕，叠加疫情及权益资产波动加大等背景，居民风险偏好下降也带动现金类及短债类产品规模大幅走高，大量资金淤积于银行间市场，且隔夜加权利率过低后有一定套利空间，配置压力及交易盘参与带动货币市场利率全期限大幅下行。3M 国股行 NCD 从 3 月底 2.35% 下行至目前 1.82% 左右位置；1Y 期限则从 2.6% 下行至 2.35% 左右位置；货币市场曲线整体仍然保持陡峭。

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。上半年在央行超预期降息以及 4 月份降准后，市场收益率均大幅走低，组合调整了平均剩余期限至中性水平，待收益率走高后再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。上半年，资金面逐步转为宽松，隔夜资金中枢始终保持在偏低水平，杠杆收益较高，因此整体杠杆水平处于偏高水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2022 年上半年，景顺长城货币 A 份额净值收益率为 0.9671%，业绩比较基准收益率为 0.6695%。

2022 年上半年，景顺长城货币 B 份额净值收益率为 1.0873%，业绩比较基准收益率为 0.6695%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前市场利率已经大幅低于政策利率，宽货币的目标基本已经达成，在中美利差倒挂的情况下，特别是 7 月份中美短端的政策利率也行将倒挂的背景下，降息概率不大。后续随着重心向宽信用转移，宽货币也将边际收敛，只不过在基本面没有大幅改善的情况下，货币政策仍将保持中性偏宽松，对应资金面合理充裕。上海北京疫情逐步缓解，6 月份信贷在政策支持下也将继续改善，从而带动基本面稳中向好，同时在政府债发行高峰过后，央行也会有意使资金价格中枢逐步向政策利率靠拢，以避免汇率压力及资本外流。当前隔夜资金价格中枢由前期 1.3% 的低点回升至 1.4% 水平，预计三季度仍将小幅缓慢上行。虽然短期内资金价格以及 1 年 CD 收益率仍将低于政策利率，但在隔夜中枢从低点反弹的过程中，各期限收益率相应也会有所调整，且调整速度可能会较快，短时间内完成对新中枢的定价。

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。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，根据市场收益率变化及时调整组合久期和结构。配置上以回购和 CD 为主，增强组合流动性。组合将合理安排资产到期，重点关注关键时点上客户申赎对组合流动性的冲击。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司合作，由其提供相关固定收益品种的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

自 2019 年 6 月 17 日起本基金的收益分配方式由“每日分配、按月支付”改为“每日分配、按日支付”。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城货币市场证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城货币市场证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	11,204,075,552.68	17,803,148,139.49
结算备付金		30,780,002.97	5,789,545.45
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	18,720,484,562.17	11,611,755,866.56
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		18,720,484,562.17	11,611,755,866.56
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	10,767,726,501.29	9,911,472,951.13
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,352,227.05	5,798,445.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	175,915,542.84
资产总计		40,727,418,846.16	39,513,880,491.17
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,079,005,663.54	2,672,556,343.72
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,883,423.42	163,441.10
应付管理人报酬		8,174,841.73	7,863,558.02
应付托管费		1,634,968.33	1,572,711.58
应付销售服务费		7,990,474.80	7,661,625.93
应付投资顾问费		-	-
应交税费		204,762.38	234,464.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	514,008.93	709,194.91
负债合计		2,099,408,143.13	2,690,761,339.74
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	38,628,010,703.03	36,823,119,151.43
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		38,628,010,703.03	36,823,119,151.43
负债和净资产总计		40,727,418,846.16	39,513,880,491.17

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 38,628,010,703.03 份，其中 A 级基金份额净值 1.0000 元，基金份额 38,113,560,978.16 份；B 级基金份额净值 1.0000 元，基金份额 514,449,724.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城货币市场证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		504,057,453.02	416,298,502.05
1. 利息收入		330,703,111.71	412,335,022.98
其中：存款利息收入	6.4.7.9	200,817,102.71	223,770,429.78
债券利息收入		-	90,479,394.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		129,886,009.00	98,085,199.18
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		173,354,341.31	3,963,479.07
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	173,354,341.31	3,963,479.07
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	-	-
以摊余成本计量的金融 资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.14	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.15	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		119,207,725.73	85,425,212.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	49,542,188.35	36,141,399.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,908,437.64	7,228,280.00
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	48,385,379.30	35,239,237.05
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		11,098,024.40	6,559,037.35
其中：卖出回购金融资产支出		11,098,024.40	6,559,037.35
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		86,007.22	78,737.74
8. 其他费用	6.4.7.16	187,688.82	178,520.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”</b>		384,849,727.29	330,873,289.29

号填列)			
减：所得税费用			-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		384,849,727.29	330,873,289.29
五、其他综合收益的税后净额			-
六、综合收益总额		384,849,727.29	330,873,289.29

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城货币市场证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	36,823,119,151.43	-	-	36,823,119,151.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	36,823,119,151.43	-	-	36,823,119,151.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列)	1,804,891,551.60	-	-	1,804,891,551.60
（一）、综合收益总额	-	-	384,849,727.29	384,849,727.29
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列)	1,804,891,551.60	-	-	1,804,891,551.60
其中：1. 基金申购款	186,964,187,464.44	-	-	186,964,187,464.44
2. 基金赎回款	-185,159,295,912.84	-	-	-185,159,295,912.84
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列)	-	-	-384,849,727.29	-384,849,727.29
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	38,628,010,703.03	-	-	38,628,010,703.03
项目	上年度可比期间			



	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	13,717,675,305.32	-	-	13,717,675,305.32
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	13,717,675,305.32	-	-	13,717,675,305.32
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	22,079,446,034.16	-	-	22,079,446,034.16
(一)、综合收益总额	-	-	330,873,289.29	330,873,289.29
(二)、本期基金份额 交易产生的基金净值 变动数 (净值减少以“-”号 填列)	22,079,446,034.16	-	-	22,079,446,034.16
其中: 1. 基金申购款	227,482,496,691.48	-	-	227,482,496,691.48
2. 基金赎回款	-205,403,050,657.32	-	-	-205,403,050,657.32
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的基金净值变动 (净值减少以“-”号 填列)	-	-	-330,873,289.29	-330,873,289.29
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	35,797,121,339.48	-	-	35,797,121,339.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城景系列开放式证券投资基金(以下简称“本系列基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第 96 号《关于同意景顺长城景系列开放式证券投资

基金设立的批复》核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》)发起，并于 2003 年 10 月 24 日募集成立。本系列基金为契约型开放式，存续期限不定，目前下设三个子基金，分别为景顺长城货币市场证券投资基金(2005 年 7 月 15 日前原为景顺长城恒丰债券证券投资基金，以下简称“本基金”)、景顺长城优选股票证券投资基金和景顺长城动力平衡证券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,835,000,215.28 元，其中包括景顺长城恒丰债券证券投资基金人民币 473,468,816.63 元、景顺长城优选股票证券投资基金人民币 820,829,988.03 元和景顺长城动力平衡证券投资基金人民币 540,701,410.62 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2003)第 144 号验资报告予以验证。本系列基金设立募集期内认购资金产生的银行利息人民币 782,418.90 元在基金募集期结束时计入投资者认购账户，折合成 782,418.90 份基金份额，其中景顺长城恒丰债券证券投资基金 258,742.20 份基金份额、景顺长城优选股票证券投资基金 262,508.27 份基金份额和景顺长城动力平衡证券投资基金 261,168.43 份基金份额，归投资者所有。

根据基金管理人 2005 年 7 月 12 日发布的《关于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结果的公告》(以下简称“公告”)，景顺长城恒丰债券证券投资基金的基金份额持有人大会于 2005 年 6 月 13 日表决通过了《关于景顺长城恒丰债券证券投资基金转变为景顺长城货币市场证券投资基金的议案》，并于 2005 年 7 月 7 日获得了中国证监会证监基金字[2005]121 号《关于核准景顺长城恒丰债券证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》。根据《关于景顺长城恒丰债券证券投资基金转变为景顺长城货币市场证券投资基金的议案》的有关规定，确定 2005 年 7 月 14 日为景顺长城恒丰债券证券投资基金的基金转变基准日，景顺长城恒丰债券证券投资基金需在此之前调整资产结构使之满足景顺长城货币市场证券投资基金的要求。

经普华永道中天会计师事务所有限公司审计(普华永道中天审字(2005)第 1720 号审计报告)，截至 2005 年 7 月 14 日止，景顺长城恒丰债券证券投资基金基金净值 81,561,919.51 元，于 2005 年 7 月 15 日按照本基金固定交易单位面值 1.00 元转变为本基金的基金净值和基金份额。景顺长城恒丰债券证券投资基金相关的资产和负债根据公告中规定的转变会计处理方法以直接结转和非直接结转的方法分别转变为本基金的资产和负债。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城景系列开放式证券投资基金下设的货币市场证券投资基金实施基金份额分级和变更业绩比较基准并修改相关基金合同的公告》，自 2010 年 4

月 30 日起,本基金将基金份额分为 A 级和 B 级,不同级别的基金份额适用不同费率的销售服务费。投资者基金账户所持有份额数量高于 500 万份(含)时,账户内所有基金份额归为 B 级,否则归为 A 级。基金份额分级后,在基金存续期内的任何一个开放日,注册登记机构根据上述分级原则对投资者基金账户所持有份额的份额级别进行判断和处理。

根据《货币市场基金监督管理办法》和《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金、期限在一年以内(含一年)的银行存款、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、期限在一年以内(含一年)的同业存单、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的短期融资券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的中期票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的原业绩比较基准为:税后一年期定期存款利率,根据《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城景系列开放式证券投资基金下设的货币市场证券投资基金实施基金份额分级和变更业绩比较基准并修改相关基金合同的公告》,本基金的业绩比较基准自 2010 年 4 月 30 日起变更为:税后同期七天存款利率。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2022 年 8 月 29 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外,本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金

成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的金融资产主要为债务工具，是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资的账面价值中。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率每日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；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。对于应收款项和其他金融负债

采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收

益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度可比期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款，金额分别为 17,803,148,139.49 元、5,789,545.45 元、9,911,472,951.13 元、175,915,542.84 元和 5,798,445.70 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 17,914,111,592.58 元、5,792,150.75 元、9,920,123,178.60 元、0.00 元和 5,798,445.70 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 11,611,755,866.56 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 11,668,055,123.54 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 2,672,556,343.72 元、163,441.10 元、7,863,558.02 元、1,572,711.58 元、7,661,625.93

元、379,631.11 元、159,767.40 元和 796.40 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 2,672,716,111.12 元、163,441.10 元、7,863,558.02 元、1,572,711.58 元、7,661,625.93 元、379,631.11 元、0.00 元和 796.40 元。

于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税

的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	4,200,608.14
等于：本金	4,199,235.29
加：应计利息	1,372.85
减：坏账准备	-
定期存款	11,199,874,944.54
等于：本金	11,100,000,000.00
加：应计利息	99,874,944.54
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1 个月（含）-3 个月	600,246,666.64
存款期限 3 个月（含）至 1 年	10,293,812,612.03
存款期限 1 年（含）以上	305,815,665.87
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	11,204,075,552.68

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元



项目		本期末 2022年6月30日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	18,720,484,562.17	18,739,265,791.77	18,781,229.60	0.0486
	合计	18,720,484,562.17	18,739,265,791.77	18,781,229.60	0.0486
资产支持证券		-	-	-	-
合计		18,720,484,562.17	18,739,265,791.77	18,781,229.60	0.0486

注：1. 偏离金额=影子定价-实际利率计算账面价值；

2. 偏离度=偏离金额/实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末衍生金融资产/负债余额为零。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,498,740,218.50	-
银行间市场	9,268,986,282.79	-
合计	10,767,726,501.29	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	20,045.64
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	390,743.74
其中：交易所市场	-
银行间市场	390,743.74
应付利息	-
预提费用	103,219.55

合计	514,008.93
----	------------

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 景顺长城货币 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,876,976,333.47	35,876,976,333.47
本期申购	186,497,781,294.14	186,497,781,294.14
本期赎回（以“-”号填列）	-184,261,196,649.45	-184,261,196,649.45
本期末	38,113,560,978.16	38,113,560,978.16

##### 景顺长城货币 B

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	946,142,817.96	946,142,817.96
本期申购	466,406,170.30	466,406,170.30
本期赎回（以“-”号填列）	-898,099,263.39	-898,099,263.39
本期末	514,449,724.87	514,449,724.87

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。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

##### 景顺长城货币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	374,348,808.35	-	374,348,808.35
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-374,348,808.35	-	-374,348,808.35
本期末	-	-	-

##### 景顺长城货币 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	10,500,918.94	-	10,500,918.94
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-10,500,918.94	-	-10,500,918.94

本期末	-	-	-
-----	---	---	---

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
活期存款利息收入		23,552.74
定期存款利息收入		200,560,908.51
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		232,641.46
其他		-
合计		200,817,102.71

#### 6.4.7.10 股票投资收益

不适用。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
债券投资收益——利息收入		165,779,087.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		7,575,253.91
债券投资收益——赎回差价收入		-
债券投资收益——申购差价收入		-
合计		173,354,341.31

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额		17,858,931,179.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额		17,744,682,818.90
减：应计利息总额		106,673,106.85
减：交易费用		-
买卖债券差价收入		7,575,253.91

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

不适用。

**6.4.7.13 股利收益**

不适用。

**6.4.7.14 公允价值变动收益**

不适用。

**6.4.7.15 其他收入**

本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.16 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	74,383.76
信息披露费	19,835.79
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	18,450.00
银行划款手续费	75,019.27
合计	187,688.82

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	49,542,188.35	36,141,399.99
其中：支付销售机构的客户维护费	24,131,131.71	17,583,439.55

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,908,437.64	7,228,280.00

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B	合计
景顺长城基金管理有限公司	6,071.77	43,828.18	49,899.95
中国银行	31,356.80	-	31,356.80
长城证券	133.88	-	133.88
合计	37,562.45	43,828.18	81,390.63
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		

名称	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B	合计
景顺长城基金管理有限公司	14,704.76	28,116.37	42,821.13
中国银行	42,112.54	17.52	42,130.06
长城证券	1,013.75	-	1,013.75
合计	57,831.05	28,133.89	85,964.94

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 级基金基金份额和 B 级基金基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给景顺长城基金管理有限公司，再由景顺长城基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 级基金基金份额和 B 级基金基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日对应级别基金资产净值 X 对应级别约定年费率 / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	1,176,400,000.00	91,555.87
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	977,250,000.00	119,771.85

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B
基金运作起始日（2005 年 7 月 15 日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	-	814,832,703.64
报告期间申购/买入总份额	-	124,337,447.80
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	483,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	456,170,151.44
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	88.6700%
项 目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B
基金运作起始日（2005年7月15日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	203,765,551.17
报告期间申购/买入总份额	-	526,452,393.26
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	58,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	672,217,944.43
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	81.0500%

注：1. 固有资金投资持有本基金 B 类基金份额，期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额；报告期末持有的基金份额占比为占 B 类基金总份额的比例。

2. 基金管理人景顺长城基金管理有限公司在本年度申购/赎回本基金的交易委托景顺长城基金管理有限公司直销中心办理，根据《景顺长城景系列开放式证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金不收取申购费用与赎回费用。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

##### 景顺长城货币 B

关联方名称	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例（%）
景顺长城资产管理（深圳）有限公司	-	-	55,460,603.84	5.8600

注：景顺长城资产管理（深圳）有限公司上年度末持有的基金份额占比为占 B 类基金总份额的比例。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-定期	1,415,363,834.26	25,154,305.91	900,000,000.00	9,442,639.18
中国银行-活期	4,200,608.14	23,552.74	3,152,976.77	26,759.94

注：本基金的活期银行存款和部分定期存款由基金托管人中国银行保管，活期存款按银行同业利率计息，定期存款按协议利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

单位：人民币元

景顺长城货币 A				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
374,348,808.35	-	-	374,348,808.35	-
景顺长城货币 B				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
10,500,918.94	-	-	10,500,918.94	-

**6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截止本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,079,005,663.54 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
------	------	-------	------------	-------	--------



112106308	21 交通银行 CD308	2022 年 7 月 1 日	99.27	1,400,000	138,977,082.07
112110419	21 兴业银行 CD419	2022 年 7 月 1 日	99.42	100,000	9,941,932.49
112110512	21 兴业银行 CD512	2022 年 7 月 1 日	99.35	1,000,000	99,348,178.98
170212	17 国开 12	2022 年 7 月 1 日	103.77	700,000	72,639,816.96
190308	19 进出 08	2022 年 7 月 1 日	102.52	2,200,000	225,538,979.92
200312	20 进出 12	2022 年 7 月 1 日	102.70	1,700,000	174,581,800.27
210211	21 国开 11	2022 年 7 月 1 日	101.93	1,700,000	173,275,568.53
210216	21 国开 16	2022 年 7 月 1 日	101.46	1,000,000	101,457,029.62
210306	21 进出 06	2022 年 7 月 1 日	101.80	1,600,000	162,874,909.87
210407	21 农发 07	2022 年 7 月 1 日	101.88	1,100,000	112,064,372.55
210411	21 农发 11	2022 年 7 月 1 日	101.58	2,400,000	243,785,312.19
220201	22 国开 01	2022 年 7 月 1 日	101.05	500,000	50,525,442.34
2203670	22 进出 670	2022 年 7 月 1 日	99.96	400,000	39,985,861.26
2203671	22 进出 671	2022 年 7 月 1 日	99.93	500,000	49,964,651.32
2203676	22 进出 676	2022 年 7 月 1 日	99.76	492,000	49,084,069.02
2203677	22 进出 677	2022 年 7 月 1 日	99.75	500,000	49,873,196.06
2203678	22 进出 678	2022 年 7 月 1 日	99.70	100,000	9,969,706.02
2203679	22 进出 679	2022 年 7 月 1 日	99.70	1,000,000	99,696,329.81
2203680	22 进出 680	2022 年 7 月 1 日	99.66	500,000	49,827,780.02
227705	22 贴现国开 05	2022 年 7 月 1 日	99.93	300,000	29,978,343.97
227706	22 贴现国开 06	2022 年 7 月 1 日	99.82	100,000	9,982,376.46
227709	22 贴现国开 09	2022 年 7 月 1 日	99.68	100,000	9,967,754.46
229914	22 贴现国债 14	2022 年 7 月 1 日	99.95	500,000	49,974,480.33
229915	22 贴现国债 15	2022 年 7 月 1 日	99.91	300,000	29,974,261.45
229917	22 贴现国债 17	2022 年 7 月 1 日	99.40	1,000,000	99,403,538.64
229928	22 贴现国债 28	2022 年 7 月 1 日	99.82	1,000,000	99,820,652.51
合计				22,192,000	2,242,513,427.12

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管

理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 43.3%（上年度末：25.62%）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种（企业债或短期融资券），并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于本报告期末，本基金前 10 名份额持有人的合计占比为 0.39%（扣除固有资金投资之后的比例），本基金投资组合的平均剩余期限为 65 天，平均剩余存续期为 65 天。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,513,131,164.04	6,152,187,557.04	3,538,756,831.60	-	-	-	-11,204,075,552.68
结算备付金	30,780,002.97	-	-	-	-	-	30,780,002.97
交易性金融资产	5,520,390,910.25	4,642,840,298.23	8,557,253,353.69	-	-	-	-18,720,484,562.17
买入返售金融资产	10,716,373,237.23	51,353,264.06	-	-	-	-	-10,767,726,501.29
应收申购款	-	-	-	-	-	4,352,227.05	4,352,227.05
其他资产	0.00	-	-0.00	-	-	-	-
资产总计	17,780,675,314.49	10,846,381,119.33	12,096,010,185.29	-	-	4,352,227.05	40,727,418,846.16
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,883,423.42	1,883,423.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	8,174,841.73	8,174,841.73
应付托管费	-	-	-	-	-	1,634,968.33	1,634,968.33
卖出回购金融资产款	2,079,005,663.54	-	-	-	-	-	2,079,005,663.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,990,474.80	7,990,474.80
应交税费	-	-	-	-	-	204,762.38	204,762.38
其他负债	-	-	-	-	-	514,008.93	514,008.93
负债总计	2,079,005,663.54	-	-	-	-	20,402,479.59	2,099,408,143.13
利率敏感度缺口	15,701,669,650.95	10,846,381,119.33	12,096,010,185.29	-	-	-	-
上年度末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,503,148,139.49	7,400,000,000.00	7,900,000,000.00	-	-	-	-17,803,148,139.49
结算备付金	5,789,545.45	-	-	-	-	-	5,789,545.45
交易性金融资产	1,640,252,861.68	3,275,710,704.51	6,695,792,300.37	-	-	-	-11,611,755,866.56
买入返售金融资产	8,881,721,486.50	1,029,751,464.63	-	-	-	-	-9,911,472,951.13
应收利息	-	-	-	-	-	175,915,542.84	175,915,542.84
应收申购款	-	-	-	-	-	5,798,445.70	5,798,445.70
资产总计	13,030,912,033.12	11,705,462,169.14	14,595,792,300.37	-	-	181,713,988.54	39,513,880,491.17
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	163,441.10	163,441.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,863,558.02	7,863,558.02

应付托管费	-	-	-	-	1,572,711.58	1,572,711.58
卖出回购金融资产款	2,672,556,343.72	-	-	-	-	2,672,556,343.72
应付销售服务费	-	-	-	-	7,661,625.93	7,661,625.93
应付交易费用	-	-	-	-	379,631.11	379,631.11
应付利息	-	-	-	-	159,767.40	159,767.40
应交税费	-	-	-	-	234,464.48	234,464.48
其他负债	-	-	-	-	169,796.40	169,796.40
负债总计	2,672,556,343.72	-	-	-	18,204,996.02	2,690,761,339.74
利率敏感度缺口	10,358,355,689.40	11,705,462,169.14	14,595,792,300.37	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-10,602,449.93	-10,213,936.52
	市场利率下降 25 个基点	10,620,144.82	10,239,800.90

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本报告期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同）。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本报告期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同），因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的

最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	18,720,484,562.17	11,611,755,866.56
第三层次	-	-
合计	18,720,484,562.17	11,611,755,866.56

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具（2021 年 12 月 31 日：同）。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	18,720,484,562.17	45.97
	其中：债券	18,720,484,562.17	45.97
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	10,767,726,501.29	26.44

	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	11,234,855,555.65	27.59
4	其他各项资产	4,352,227.05	0.01
5	合计	40,727,418,846.16	100.00

注：银行存款和结算备付金合计中包含定期存款 11,199,874,944.54 元。

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	2.87	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	2,079,005,663.54	5.38
	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%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 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	65
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	56

### 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。

### 7.3.2 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	45.95	5.38
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	15.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	10.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

4	90 天（含）—120 天	5.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	26.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		105.01	5.38

#### 7.4 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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	279,172,932.93	0.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,715,871,415.59	4.44
	其中：政策性金融债	1,715,871,415.59	4.44
4	企业债券	51,910,678.92	0.13
5	企业短期融资券	2,549,924,794.23	6.60
6	中期票据	205,507,273.76	0.53
7	同业存单	13,918,097,466.74	36.03
8	其他	-	-
9	合计	18,720,484,562.17	48.46
10	剩余存续期超过 397 天 的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	按实际利率计算的 账面价值（元）	占基金资产 净值比例（%）
1	112117122	21 光大银行 CD122	7,000,000	699,289,881.95	1.81
2	112210046	22 兴业银行 CD046	5,000,000	499,114,486.61	1.29
3	112105225	21 建设银行 CD225	5,000,000	496,406,975.91	1.29
4	112110408	21 兴业银行 CD408	4,900,000	486,972,962.69	1.26
5	012105504	21 南电 SCP016	4,000,000	403,995,231.24	1.05
6	112212061	22 北京银行 CD061	4,000,000	397,051,692.48	1.03
7	012280687	22 电网 SCP005	3,000,000	301,668,879.21	0.78
8	112216006	22 上海银行 CD006	3,000,000	299,770,086.54	0.78
9	112112104	21 北京银行 CD104	3,000,000	299,707,496.28	0.78
10	112212094	22 北京银行 CD094	3,000,000	299,574,938.48	0.78



## 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0623%
报告期内偏离度的最低值	0.0219%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0393%

### 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 0.5%的情况。

## 7.8 期末按实际利率计算的账面价值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。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 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。

### 7.9.2 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

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。

2022 年 5 月 24 日，光大银行因老产品规模在部分时点出现反弹等违法违规行为，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，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〕31 号），被罚款 400 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光大银行进行了投资。

兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码：601166）于 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。

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 2021 年 8 月 20 日收到中国人民银行出具的行政处罚决定书(银罚字(2021)22 号), 其因占压财政存款或者资金、违反账户管理规定, 被处以罚款人民币 388 万元。

建设银行于 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)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。

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 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。

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。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	4,352,227.05
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,352,227.05

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
景顺长城货币A	4,635,897	8,221.40	32,379,550.84	0.08	38,081,181,427.32	99.92
景顺长城货币B	6	85,741,620.81	456,193,660.04	88.68	58,256,064.83	11.32
合计	4,635,903	8,332.36	488,573,210.88	1.26	38,139,437,492.15	98.74

注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采

用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	个人	28,745,139.40	0.08
2	个人	28,214,532.83	0.07
3	个人	18,623,657.44	0.05
4	个人	13,069,419.09	0.03
5	个人	11,391,528.03	0.03
6	个人	10,655,212.57	0.03
7	个人	10,514,261.59	0.03
8	个人	10,211,636.77	0.03
9	个人	8,796,373.04	0.02
10	个人	8,249,287.45	0.02

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	景顺长城货币 A	33,899.51	0.000089
	景顺长城货币 B	-	-
	合计	33,899.51	0.000088

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	景顺长城货币 A	-
	景顺长城货币 B	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城货币 A	0~10
	景顺长城货币 B	-
	合计	0~10

## §9 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
基金运作起始日（2005 年 7 月 15 日）基金份额总额	81,561,919.51	-
本报告期期初基金份额总额	35,876,976,333.47	946,142,817.96
本报告期基金总申购份额	186,497,781,294.14	466,406,170.30
减：本报告期基金总赎回份额	184,261,196,649.45	898,099,263.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	38,113,560,978.16	514,449,724.87
-------------	-------------------	----------------

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。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长城证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

2、本基金本期交易单元未发生变更。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长城证券股份有限公司	-	-	30,743,606,000.00	96.29	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	1,184,164,000.00	3.71	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-01
2	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-07
3	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-20
4	景顺长城货币市场证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-24
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-24
6	景顺长城基金管理有限公司关于投资旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-27
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-18
8	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-25
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-04
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-28
11	景顺长城货币市场证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-28
12	景顺长城基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司和北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-01
13	景顺长城基金管理有限公司关于系统停	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-08

	机升级的公告		
14	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-12
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-16
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
17	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
18	景顺长城基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
19	景顺长城货币市场证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
20	景顺长城基金管理有限公司关于终止上海朝阳永续基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-27
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-29
22	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-06
23	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-12
24	景顺长城基金管理有限公司关于暂停腾元基金、汇付基金、南京途牛和有鱼基金办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-26
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-10
26	景顺长城货币市场证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-16
27	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



## §12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 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 8 月 31 日