

景顺长城货币市场证券投资基金 2024 年第 4 季度报告

2024 年 12 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：2025 年 1 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 2025 年 1 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 2024 年 10 月 1 日起至 2024 年 12 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	50,808,400,528.64 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	50,166,065,993.40 份	642,334,535.24 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 10 月 1 日-2024 年 12 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	173,053,759.27	2,302,980.89
2. 本期利润	173,053,759.27	2,302,980.89
3. 期末基金资产净值	50,166,065,993.40	642,334,535.24

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	0.3637%	0.0010%	0.3393%	0.0000%	0.0244%	0.0010%
过去六个月	0.7324%	0.0008%	0.6787%	0.0000%	0.0537%	0.0008%
过去一年	1.6546%	0.0015%	1.3500%	0.0000%	0.3046%	0.0015%
过去三年	5.4172%	0.0012%	4.0500%	0.0000%	1.3672%	0.0012%
过去五年	10.0163%	0.0013%	6.7500%	0.0000%	3.2663%	0.0013%
自基金合同 生效起至今	62.2370%	0.0055%	32.2363%	0.0018%	30.0007%	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	0.4242%	0.0010%	0.3393%	0.0000%	0.0849%	0.0010%
过去六个月	0.8539%	0.0008%	0.6787%	0.0000%	0.1752%	0.0008%
过去一年	1.8984%	0.0015%	1.3500%	0.0000%	0.5484%	0.0015%
过去三年	6.1784%	0.0012%	4.0500%	0.0000%	2.1284%	0.0012%
过去五年	11.3423%	0.0013%	6.7500%	0.0000%	4.5923%	0.0013%

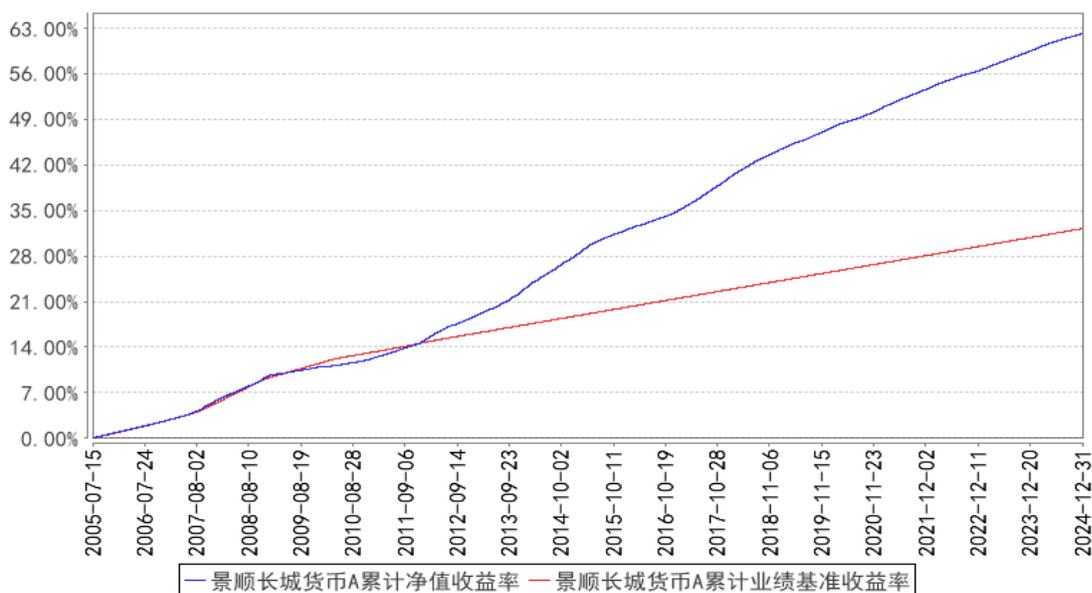
自基金合同生效起至今	51.1093%	0.0048%	19.9873%	0.0001%	31.1220%	0.0047%
------------	----------	---------	----------	---------	----------	---------

注：1、本基金自 2010 年 4 月 30 日起实行份额分级；

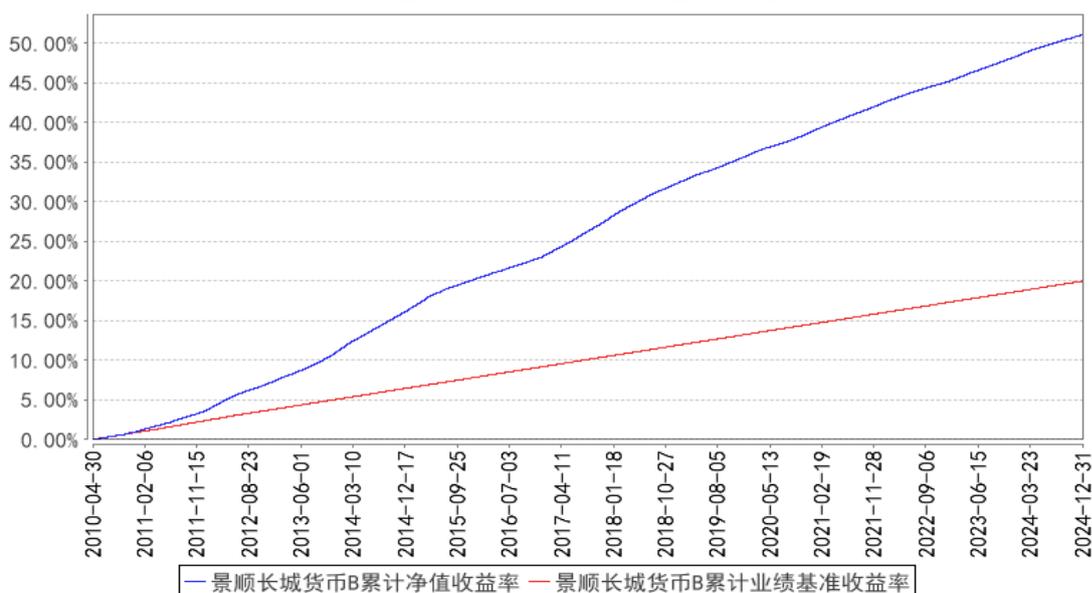
2、自 2019 年 6 月 17 日起本基金的收益分配方式由每日分配，按月结转份额改为每日分配，按日结转份额。

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 3 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

“924”一揽子增量逆周期刺激政策加码以来，四季度宏观经济基本面企稳回升，其中需求端的消费以及生产端的服务业生产指数回升尤其明显，市场微观主体信心有所改善，地产销售也出现了明显的回暖。叠加前期一直偏紧缩的财政支出力度在四季度大幅扩张，进一步助力宏观经济基本面持续改善，全年经济社会发展主要目标任务将顺利完成。四季度宏观数据方面，居民消费和地产销售成为经济两大亮点。居民消费回暖，10、11 两个月社零平均增速 3.9% 相比新政前三个月平均 2.7% 的增速明显改善，其中受“以旧换新”政策支持的品类，包括家电、汽车等，改善尤其明显。房地产销售大幅改善，其中一线城市的房价率先企稳回升，连续两个月实现了环比 0.4% 的正增长，“926”政治局会议首次提出“要促进房地产市场止跌回稳”、“1209”政治局会议再提出“稳住楼市股市”，一线城市的房价有望率先打出示范效应。

四季度，市场流动性整体保持宽裕，央行通过多种货币政策工具维持资金面相对平稳，但资金中枢仍保持高位。四季度，对市场流动性扰动因素除一些季节性因素外，政府债集中发行也阶段性对资金面产生一定影响。11 月 8 日全国人大常委会批准增加 6 万亿元地方政府债务限额，其中年内将 2024 年 2 万亿额度集中在 11、12 月发行完毕，因此对四季度的资金面造成一定考验。从对冲手段来看，央行当季并未进行降准降息操作，同时在公开市场操作方面也较为克制，表现为 OMO 投放规模较前期明显减小，仅在 10 月中下旬缴税期间大额投放万亿元，同时 MLF 余额也从三季度末的 68780 亿元下降至当前 50890 亿元，当季共计回笼近 1.8 万亿。除传统货币政策工具外，央行在创新工具方面态度更为积极，四季度在国债买卖方面共计净买入国债 7000 亿元；另外在 10 月 28 日央行公告启用公开市场买断式逆回购操作工具，当季在买断式回购操作上央行共计净投放 2.7 万亿元。创新型货币政策工具的使用，有效补充了因 MLF 缩量和再融资债集中发行造成的流动性缺口，因此四季度银行间流动性整体上并未明显收敛。从价格角度来看，受政府债发

行的阶段性扰动以及在美元指数走高后人民币汇率承压影响，DR007 月均值分别为 1.66%、1.67% 和 1.71%，资金中枢较三季度明显下行，但仍处于政策利率之上。

四季度，更为重要的货币政策方面的变化是 12 月初政治局会议以及中央经济工作会议上对于未来货币政策的表述，时隔 10 多年，货币政策取向从“稳健”再次改为“适度宽松”，将“保持流动性合理充裕”改为“保持流动性充裕”，体现出更为积极的宽松意图。

NCD 收益率在国庆节前后跟随债券市场有所调整，1 年期国股行 NCD 在节后冲高至 1.96% 后开启震荡下行，2 万亿再融资债于 11 月下旬发行过半，并未对资金面造成太大影响，NCD 收益率在 11 月底缓慢下行至 1.85%。11 月 28 日市场利率定价自律机制通过了《关于优化非银同业存款利率自律管理的自律倡议》，该倡议建议同业活期利率参考 OMO 利率，同时同业定期存款提支利率不得高于超额准备金利率，因同业活期利率下降，同业存款配置比例被动压降，市场对未来货币市场收益率下行预期加强，因此加大了对同业存单的配置力度，1 年期国股行 NCD 收益率快速震荡下行，年底前突破 1.6% 创下年内新低。截至年末时点 3 个月和 1 年期 AAA 评级 NCD 分别收于 1.595% 和 1.575%，较三季末分别下行 28BP 和 34BP，长短端曲线倒挂。全年来看，3 个月和 1 年期 AAA 评级 NCD 收益率较年初分别大幅下行 71BP 和 87BP。

现券方面，国债收益率曲线从高位大幅下行，各期限品种在不同因素带动下均触及年内新低。债券市场对于基本面有所钝化，因此四季度的经济金融数据对债市影响有限，收益率的变化更多源自政策预期以及机构行为。国庆节后在风险偏好和刺激政策预期升温的影响下，长债收益率维持震荡，随着买断式逆回购工具落地，资金预期转松，同时稳增长各项政策逐步落地以及年内的 2 万亿再融资债供给高峰过后，叠加风险偏好有所走弱，债市情绪重回乐观，利率又转而下行。10 年国债收益率在 12 月初破 2% 后，政治局会议对于货币政策表述的改变使得市场对于明年降准降息空间预期加强，也点燃了债市进一步做多热情，特别是市场抢跑年未年初配置行情，使得 10 年国债活跃券盘中最低触及 1.665% 的历史低点。12 月中下旬，有报道称央行约谈本轮债市行情中部分交易激进的金融机构，并针对债券市场违法违规行为进行处罚，长债收益率从低点有所反弹，但临近年末再次下行并收于年内低点。而 30 年国债一方面受到再融资债发行影响，另一方面也受制于央行持续卖出超长端地方债，30-10 的期限利差在四季度有所走阔。对于中短端品种，利好因素除上述提到的政策预期减弱、货币政策表述的改变以及市场利率定价自律机制对于同业活期的规范外，机构行为也带动短端品种快速下行。央行加大了国债买卖规模，同时商业银行出于年末各项指标的考虑，也加大了短久期国债和政金债的配置力度，带动中短久期品种收益率大幅下行，各期限均创出历史低点后在年末有所调整。截至年末，1 年、3 年、5 年、10 年、30 年国债收益率分别收于 1.08%、1.19%、1.42%、1.67% 和 1.91%，较季度初分别下行 28BP、38BP、42BP、

48BP 和 44BP。全年来看，各期限较去年末分别大幅下行 100BP、110BP、98BP、88BP 和 91BP，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。四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。受市场利率定价自律机制对于同业存款提支的要求，组合的存款配置占比明显下降，转为更多的以同业存单、逆回购和信用债配置为主。因存款存单收益率大幅下行，且与资金价格倒挂，杠杆收益不明显，因此组合杠杆水平整体保持在偏低水平。

12 月的政治局会议和中央经济工作会议发出明确讯号，将扩大内需列为 2025 年经济工作的重要着力点，将大力提振消费列为明年重点任务之首。在当前复杂多变的外部环境下，两次会议定调更加积极有为，明确提出“更加积极”财政政策与“适度宽松”货币政策，推出多项增量举措，释放出较大的政策想象空间。12 月 24 日财政工作会议指出，2025 年财政政策要“加大支出强度、加快支出进度”；25 日国务院办公厅发布《关于优化完善地方政府专项债券管理机制的意见》，有助于显著提升专项债使用效率。2025 年经济有望在政策的持续加力和靠前发力下延续回暖的势头，从而带动微观主体的信心进一步修复，微观主体的经济体感也有望明显改善。

对于债市而言，12 月的政治局会议以及中央经济工作会议对于维稳经济的定调较为积极，市场对于“超常规”的政策仍有期待，“强预期”到“强现实”的转变仍需要政策落地以及评估落地后的效果，对于基本面的复苏强度仍有待观察。逆周期调节过程中，财政的广义赤字率明年有望达到 10%，但财政政策面临约束较多，同时当前财政的乘数效应较 08 年、15 年也有所下降，集中化债、放松地方债发行条件有助于缓解地方政府现金流压力，后续仍需要带动地方政府投资积极性才可以更好地发挥稳增长作用。明年货币政策将更为积极，“适度宽松”的基调下，预计央行将加大降准降息幅度以及国债买卖的力度。有效需求不足的问题还有待解决，叠加化债背景下，资产荒也将延续，这在中长期将成为债券收益率继续突破前低的有效支撑。

短期来看，10 年国债创新低，5 年内利率债基本上均低于公开市场利率，反映出市场已经对降息进行了一定程度的定价。跨年后，面临税期和春节前取现需求激增，以及可能的政府债发行前置，降准有望更早落地。受开门红影响，年初的经济数据预计同比企稳，同时特朗普就职后对外政策如何落地也带有不确定性，在出口并未显著恶化的情况下，降息的迫切性有所减弱。因此在利率债收益率与资金中枢倒挂的情况下，短久期品种面临一定反弹压力，而年初止盈盘与配置盘博弈过程中也可能限制长债收益率进一步下行的空间。收益率低位，债市处于高胜率和低赔率的组合，降息落地前收益率上行空间不大，如果有调整则是比较好的配置机会。

2025 年初，非银同业存款利率自律管理的影响仍将主导货币市场走势，同业活期利率明显调

降以及同业存款投资受限后，非银机构特别是货币基金和现金理财将加大回购融出和 NCD 的配置，银行间流动性分层预计得以缓解，体现为 DR007 与 R007 价差有望收窄。银行也将加大 NCD 发行力度，但供需结构上存在一定期限错配，因此 NCD 曲线有望呈现陡峭化趋势。

组合将密切关注宏观基本面数据、监管政策、机构行为对市场的扰动以及央行货币政策操作，精细化管理组合流动性。考虑到一季度降准降息的确定性较强，组合将维持偏长久期。配置上以 NCD 和逆回购为主，因存款占比降低，组合将面临更大的利率风险，在收益率低点也要更加关注市场波动带来的组合偏离度的压力。跨年后组合将视资金中枢变动情况决定杠杆水平，并密切关注权益市场波动、理财端负债的稳定性以及债券发行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

本报告期内，景顺长城货币 A 类净值收益率为 0.3637%，业绩比较基准收益率为 0.3393%。

本报告期内，景顺长城货币 B 类净值收益率为 0.4242%，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	27,326,432,942.80	51.21
	其中：债券	27,326,432,942.80	51.21
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	12,947,329,904.09	24.26
	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	13,051,615,159.98	24.46
4	其他资产	36,250,422.40	0.07
5	合计	53,361,628,429.27	100.00

注：银行存款和结算备付金合计中包含定期存款 12,993,492,225.05 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	6.82	
	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	2,528,051,000.41	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	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88
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	34.87	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	9.89	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	20.21	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	7.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	31.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.61	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,892,175,172.61	7.66
	其中：政策性金融债	2,758,437,014.87	5.43
4	企业债券	1,227,818,149.56	2.42
5	企业短期融资券	2,343,043,508.84	4.61
6	中期票据	226,163,209.99	0.45
7	同业存单	19,637,232,901.80	38.65
8	其他	-	-
9	合计	27,326,432,942.80	53.78
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	112412048	24 北京银行 CD048	5,000,000	497,197,695.37	0.98
2	112472765	24 南京银行 CD276	5,000,000	495,795,022.77	0.98
3	112405145	24 建设银行 CD145	4,000,000	398,938,824.90	0.79
4	112486995	24 宁波银行 CD138	4,000,000	398,211,836.77	0.78
5	240301	24 进出 01	3,600,000	366,838,353.90	0.72
6	112414043	24 江苏银行 CD043	3,500,000	348,701,257.99	0.69
7	150218	15 国开 18	3,200,000	328,239,917.28	0.65
8	240421	24 农发 21	3,200,000	321,671,176.64	0.63
9	240431	24 农发 31	3,200,000	320,819,508.34	0.63
10	240401	24 农发 01	3,100,000	314,625,925.54	0.62

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	0.0615%
报告期内偏离度的最低值	0.0147%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0338%

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。

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

北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。

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。

国家开发银行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	60,131.67
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	36,190,290.73
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	36,250,422.40

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	43,398,561,929.04	465,902,306.78
报告期期间基金总申购份额	107,436,185,343.54	1,763,686,444.14
报告期期间基金总赎回份额	100,668,681,279.18	1,587,254,215.68

报告期期末基金份额总额	50,166,065,993.40	642,334,535.24
-------------	-------------------	----------------

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	2024-10-08	126,626.23	126,626.23	-
2	红利再投	2024-10-09	15,634.53	15,634.53	-
3	红利再投	2024-10-10	15,712.31	15,712.31	-
4	红利再投	2024-10-11	15,664.12	15,664.12	-
5	红利再投	2024-10-14	45,424.20	45,424.20	-
6	红利再投	2024-10-15	14,075.32	14,075.32	-
7	红利再投	2024-10-16	15,439.92	15,439.92	-
8	红利再投	2024-10-17	14,785.66	14,785.66	-
9	红利再投	2024-10-18	14,376.49	14,376.49	-
10	红利再投	2024-10-21	46,059.37	46,059.37	-
11	红利再投	2024-10-22	14,495.79	14,495.79	-
12	红利再投	2024-10-23	15,069.61	15,069.61	-
13	红利再投	2024-10-24	14,831.49	14,831.49	-
14	红利再投	2024-10-25	15,023.83	15,023.83	-
15	红利再投	2024-10-28	44,415.63	44,415.63	-
16	红利再投	2024-10-29	14,331.01	14,331.01	-
17	红利再投	2024-10-30	14,679.08	14,679.08	-
18	红利再投	2024-10-31	15,018.32	15,018.32	-
19	红利再投	2024-11-01	13,121.47	13,121.47	-
20	红利再投	2024-11-04	44,049.33	44,049.33	-
21	红利再投	2024-11-05	14,358.11	14,358.11	-
22	红利再投	2024-11-06	14,730.53	14,730.53	-
23	红利再投	2024-11-07	15,006.89	15,006.89	-
24	红利再投	2024-11-08	15,198.34	15,198.34	-
25	红利再投	2024-11-11	44,907.18	44,907.18	-
26	红利再投	2024-11-12	30,510.90	30,510.90	-
27	红利再投	2024-11-13	32,491.88	32,491.88	-
28	红利再投	2024-11-14	12,152.93	12,152.93	-
29	红利再投	2024-11-15	21,428.18	21,428.18	-
30	申赎	2024-11-15	5,000,000.00	5,000,000.00	-
31	红利再投	2024-11-18	41,362.00	41,362.00	-
32	红利再投	2024-11-19	29,303.18	29,303.18	-
33	红利再投	2024-11-20	14,476.17	14,476.17	-
34	红利再投	2024-11-21	15,794.94	15,794.94	-
35	红利再投	2024-11-22	13,966.68	13,966.68	-
36	红利再投	2024-11-25	41,759.28	41,759.28	-

37	红利再投	2024-11-26	24,856.98	24,856.98	-
38	红利再投	2024-11-27	14,557.27	14,557.27	-
39	红利再投	2024-11-28	16,716.12	16,716.12	-
40	红利再投	2024-11-29	14,812.67	14,812.67	-
41	红利再投	2024-12-02	44,421.83	44,421.83	-
42	红利再投	2024-12-03	19,886.98	19,886.98	-
43	红利再投	2024-12-04	19,446.68	19,446.68	-
44	红利再投	2024-12-05	12,704.00	12,704.00	-
45	红利再投	2024-12-06	13,581.02	13,581.02	-
46	红利再投	2024-12-09	46,705.17	46,705.17	-
47	红利再投	2024-12-10	14,670.46	14,670.46	-
48	红利再投	2024-12-11	15,262.00	15,262.00	-
49	红利再投	2024-12-12	14,946.10	14,946.10	-
50	红利再投	2024-12-13	14,971.57	14,971.57	-
51	红利再投	2024-12-16	43,635.89	43,635.89	-
52	红利再投	2024-12-17	14,784.83	14,784.83	-
53	红利再投	2024-12-18	14,131.29	14,131.29	-
54	红利再投	2024-12-19	14,518.79	14,518.79	-
55	红利再投	2024-12-20	14,118.62	14,118.62	-
56	红利再投	2024-12-23	44,094.13	44,094.13	-
57	红利再投	2024-12-24	14,820.95	14,820.95	-
58	红利再投	2024-12-25	14,792.74	14,792.74	-
59	红利再投	2024-12-26	14,538.69	14,538.69	-
60	红利再投	2024-12-27	14,025.57	14,025.57	-
61	红利再投	2024-12-30	44,670.54	44,670.54	-
62	红利再投	2024-12-31	17,900.33	17,900.33	-
合计			6,439,852.12	6,439,852.12	

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
2025 年 1 月 22 日