

# 景顺长城货币市场证券投资基金 2024 年第 2 季度报告

2024 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

报告送出日期：2024 年 7 月 19 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 7 月 18 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 4 月 1 日起至 2024 年 6 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	44,134,674,312.40 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	43,762,087,705.10 份	372,586,607.30 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 4 月 1 日-2024 年 6 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	181,943,042.07	1,154,081.23
2. 本期利润	181,943,042.07	1,154,081.23
3. 期末基金资产净值	43,762,087,705.10	372,586,607.30

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	0.4127%	0.0006%	0.3357%	0.0000%	0.0770%	0.0006%
过去六个月	0.9155%	0.0018%	0.6713%	0.0000%	0.2442%	0.0018%
过去一年	1.8622%	0.0014%	1.3519%	0.0000%	0.5103%	0.0014%
过去三年	5.7536%	0.0012%	4.0519%	0.0000%	1.7017%	0.0012%
过去五年	10.4958%	0.0017%	6.7519%	0.0000%	3.7439%	0.0017%
自基金合同 生效起至今	61.0574%	0.0055%	31.5576%	0.0018%	29.4998%	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	0.4724%	0.0005%	0.3357%	0.0000%	0.1367%	0.0005%
过去六个月	1.0357%	0.0018%	0.6713%	0.0000%	0.3644%	0.0018%
过去一年	2.1070%	0.0014%	1.3519%	0.0000%	0.7551%	0.0014%
过去三年	6.5176%	0.0012%	4.0519%	0.0000%	2.4657%	0.0012%
过去五年	11.8263%	0.0016%	6.7519%	0.0000%	5.0744%	0.0016%

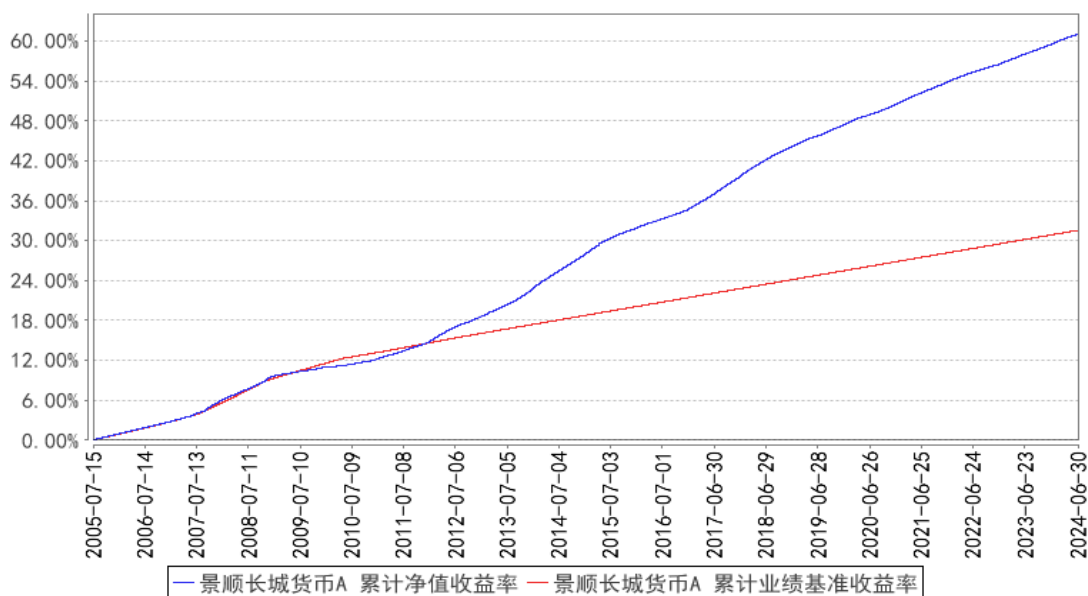
自基金合同生效起至今	49.8299%	0.0049%	19.3086%	0.0001%	30.5213%	0.0048%
------------	----------	---------	----------	---------	----------	---------

注：1、本基金自 2010 年 4 月 30 日起实行份额分级；

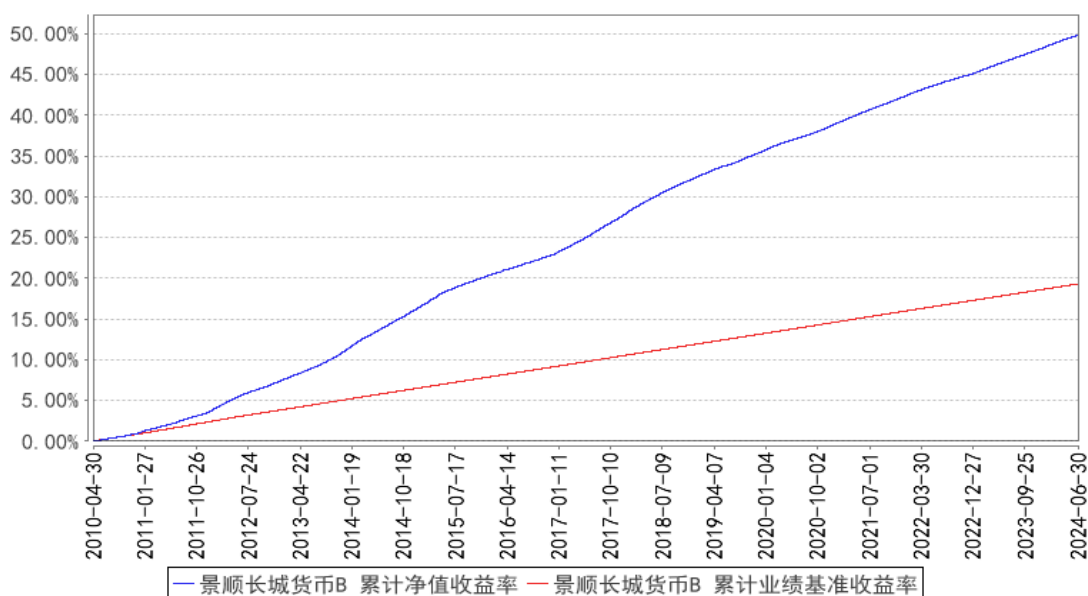
2、自 2019 年 6 月 17 日起本基金的收益分配方式由每日分配，按月结转份额改为每日分配，按日结转份额。

### 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 3 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度国内经济实现了较为强劲的开局之后，二季度经济边际有所走弱，多项经济指标放缓。5、6 两月 PMI 重新跌入收缩区间，基建投资逐月下滑，居民消费未能延续向上修复态势，货币增速大幅下滑，反映出经济企稳回升的过程遭遇波折。结构性亮点依然在出口，出口增速在全球制造业周期上行以及基数走低的背景下大幅好转，带动工业生产保持韧性，但是内需在地产持续下行、居民预期偏弱的背景下仍旧疲弱。二季度信贷投放大幅走弱，4、5 两月合计同比少增 3988 亿元，居民端和企业端双双疲弱。除了内生融资需求疲弱外，监管层打击“手工补息”、防止资金“沉淀空转”以及金融业增加值核算改革等因素都对信贷投放造成冲击。M1 和 M2 增速也在二季度大幅下行，其中 5 月 M1 同比增速-4.2%，跌幅创历史新低。地产销售端和投资端的表现依旧疲弱，销售面积跌幅 20% 以上，相比一季度跌幅有所加深，“517”地产新政对销售提振作用有限；投资端的跌幅逐月扩大，5 月累计同比下跌 10.1%，新开工和竣工的跌幅更深，累计同比分别下跌 24.2% 和 20.1%。制造业投资延续了去年以及今年一季度的亮眼表现，4、5 两月投资增速保持在 9% 以上的高增速，并且设备投资表现尤其突出，5 月增速上行至 18%。消费有所放缓，未能延续今年一季度向上修复的态势，二季度 4、5 两月社零平均增速 3%，相比一季度的 4.7% 有明显的回落。

二季度，银行间资金面整体保持平稳，资金分层状况大幅缓解，但资金中枢多数情况下仍处于政策利率之上。从央行货币政策执行情况来看，当季流动性保持稳定，因此央行仅在月末、税期等关键时点通过 OMO 投放短期流动性维稳。因 MLF 利率相对 NCD 仍处于高位，二季度整体缩量续作，MLF 余额持续回落。4 月份，禁止“手工补息”规定出台，大行负债受此影响较大，存款流失至中小行以及广义基金，造成流动性分层缓解，R001 与 DR007 利差压缩甚至偶有倒挂，银行间杠杆维持低位，这也是二季度流动性相对宽松的原因之一。5 月份特别国债发行计划出炉，供给相对平滑，同时二季度地方债发行节奏偏缓，这也是造成流动性整体平稳的另一个原因。从价格

角度来看，央行在二季度仍未调整政策利率，DR007 月均值分别为 1.88%、1.85%和 1.87%，资金中枢仍处于政策利率之上，仅在 6 月初有部分时间 DR007 低于 1.8%水平。

受“手工补息”影响，NCD 收益率在 4 月份大幅下行，月末随着超长债反弹至月初高点。之后银行通过主动负债补充流动性缺口，而非银配置力量也相对强势，在银行负债再平衡的过程中，NCD 收益率持续下行，至季末时点 1 年 AAA NCD 收益率突破年底低点至 1.96%，较一季末大幅下行 27BP。

现券市场方面，二季度整体收益率继续下行，中短端下行幅度更大，长端和超长端受供给和央行预期管理影响有所波动，下行幅度不及短端，曲线陡峭。4 月中上旬市场在资金面相对宽松，银行禁止手动补息揽储以及配置需求相对旺盛的背景下债市收益率震荡下行，下旬开始央行有关部门提示投资者重视长端利率风险后收益率开始快速上升，叠加市场对地产放松限购预期的进一步加强使得收益率有较为明显的上行。5、6 月份，整体资金面仍保持宽松，特别是 6 月初资金中枢一度低于 1.8%，市场对于降息预期渐浓，中短端品种收益率从 4 月高点持续下行。而长端特别是 30 年超长债，因央行持续的风险提示，叠加 517 地产新政的扰动，5 月基本处于窄幅震荡态势，但期间也累积了一定做多力量。因无明显利空因素，基本面和风险偏好带动下 30 年终于在 6 月份突破 2.5%的央行合意点位，并进一步下行创出年内新低。截至二季度末，3 年、5 年、10 年、30 年国债活跃券分别收于 1.8%、1.96%、2.2%、2.42%，较季度初分别下行 31BP、22BP、8BP 和 6BP，曲线陡峭化下行。

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。二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，因此组合杠杆水平均保持在偏低水平，半年末前逆回购占比逐步提升。

展望三季度，我们认为国内经济环比二季度能够边际回升。发行进度明显落后的地方政府债有望提速，地方债项目落地有望带动银行配套信贷投放，设备更新和消费品以旧换新也有望在金融端获得更多支持，三季度信贷有望边际改善。“607”国常会提出“继续研究储备新的去库存、稳市场政策措施”，稳地产政策有望持续出台。国务院发布《推动大规模设备更新和消费品以旧换新行动方案》，设备投资有望延续高增速。房价环比的加速下行对居民资产负债表的冲击依旧持续抑制居民的消费意愿，但是三季度随着财政力度的边际扩大，有望带动经济边际回暖，从而带动居民就业和收入边际改善，叠加三季度进入暑期出游旺季，有望带动消费向上修复。通胀将会维持偏弱回升的态势。随着专项债的加速发行使用叠加超长期特别国债项目的落地，有望带动

基建实物工作量提升，从而对 PPI 价格形成支撑，但是房地产维持弱势、结构性供需错配依旧对价格形成持续压制，价格偏弱的格局将会延续。

三季度，基本面方面对债市仍有支撑，受地方化债、贷款盘活存量等高质量发展目标的影响，实体经济需求不足的问题仍将制约经济向上弹性，因此债市仍维持多头思维。517 地产新政出台后，一线城市均跟进各自放松政策，预计短期对成交量会有一定提振，但房价预期以及收入预期的本质未发生根本性改变，同时房贷利率与其他资产收益率相比仍处于偏高水平，也抑制了购房需求，地方对于市场化收储的积极性不高，去库效果仍待观察。当前市场对地产政策进一步放松有所钝化，短期也不构成债市的制约因素。

央行多次提示长债风险后，当前 30 年国债收益率已经突破 2.5% 合意点位，在没有明显利空因素的情况下，考虑到期限结构较为陡峭，长端仍有下行空间。至于央行是否会采取实际行动对长债进行干预，仍需要重点关注，等待右侧交易可能是最优策略。未来央行降准降息操作概率仍较大，稳地产也要求 LPR 利率进一步下行，在净息差压力下也需要倒逼银行存款利率的下调，广谱利率中枢未来仍有下行基础。

对于资金面，央行的态度仍维持流动性合理充裕，基于基本面也没有收紧的理由，重点需要观察政府债发行节奏是否提速，可能阶段性造成资金摩擦加大。短时间内，禁止手工补息造成的衰退式宽松加剧了“资产荒”问题，跨季后资金中枢有望缓慢下行，从而打开短端下行的空间。

因当前各期限收益率基本上都达到年底低点，止盈压力下预计波动也将加大，但各类机构同时也面临欠配压力，而且从期限利差、杠杆水平、长债拥挤度等指标所反映的市场结构也相对健康，即使调整空间也不大。中短端确定性更大，长端风险也可控，若有调整也是较好的买入机会。

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。三季度，预计资金面变化不大，考虑到未来降准降息的可能，组合将维持偏长久期。组合将密切关注跨季后资金面变化，灵活调整久期和杠杆。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。组合将关注政府债供给对市场流动性的影响，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 2 季度，景顺长城货币 A 类净值收益率为 0.4127%，业绩比较基准收益率为 0.3357%。

2024 年 2 季度，景顺长城货币 B 类净值收益率为 0.4724%，业绩比较基准收益率为 0.3357%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。



## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	15,252,965,711.79	34.25
	其中：债券	15,252,965,711.79	34.25
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	14,040,261,029.18	31.53
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	15,206,897,212.00	34.15
4	其他资产	35,949,779.42	0.08
5	合计	44,536,073,732.39	100.00

注：银行存款和结算备付金合计中包含定期存款 14,956,411,597.04 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	0.75	
	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	380,764,029.33	0.86
	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	87
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	71

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内，本货币基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

#### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净 值的比例（%）	各期限负债占基金资产净 值的比例（%）
----	--------	------------------------	------------------------

1	30 天以内	41.09	0.86
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	8.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	12.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	1.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	36.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.46	0.86

#### 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	39,946,837.03	0.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,013,981,655.48	6.83
	其中：政策性金融债	1,976,612,610.69	4.48
4	企业债券	431,773,369.87	0.98
5	企业短期融资券	1,834,335,531.82	4.16
6	中期票据	306,298,749.46	0.69
7	同业存单	9,626,629,568.13	21.81
8	其他	-	-
9	合计	15,252,965,711.79	34.56
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	7,000,000	715,949,546.23	1.62
2	112303205	23 农业银行 CD205	4,000,000	398,122,910.44	0.90
3	112492734	24 南京银行 CD028	4,000,000	396,406,240.68	0.90
4	012480391	24 电网 SCP007	3,000,000	302,393,621.71	0.69
5	012480917	24 浙交投 SCP006	3,000,000	301,515,052.47	0.68
6	112413020	24 浙商银行 CD020	3,000,000	299,396,173.90	0.68
7	112498719	24 重庆农村商行 CD051	3,000,000	299,265,450.71	0.68

8	112480537	24 深圳农商银行 CD075	3,000,000	298,843,367.99	0.68
9	112413038	24 浙商银行 CD038	3,000,000	298,538,942.36	0.68
10	112497107	24 宁波银行 CD026	3,000,000	298,139,146.66	0.68

### 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	0.0445%
报告期内偏离度的最低值	0.0201%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0328%

#### 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

中国农业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。

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。

浙商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。

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没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

## 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	35,949,779.42
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	35,949,779.42

## 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	44,681,992,261.29	991,824,114.51
报告期期间基金总申购份额	82,146,967,222.04	596,374,093.05
报告期期间基金总赎回份额	83,066,871,778.23	1,215,611,600.26
报告期期末基金份额总额	43,762,087,705.10	372,586,607.30

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	申赎	2024-04-01	923,073,574.04	-923,073,574.04	-
2	申赎	2024-04-01	220,416.57	-220,416.57	-
3	申赎	2024-04-09	5,000,000.00	5,000,000.00	-
4	申赎	2024-04-10	5,000,000.00	5,000,000.00	-
5	红利再投	2024-04-10	327.15	327.15	-
6	申赎	2024-04-11	5,000,000.00	5,000,000.00	-
7	红利再投	2024-04-11	546.96	546.96	-
8	申赎	2024-04-12	5,000,000.00	5,000,000.00	-
9	红利再投	2024-04-12	847.86	847.86	-
10	红利再投	2024-04-15	3,207.78	3,207.78	-
11	申赎	2024-04-16	5,000,000.00	5,000,000.00	-
12	红利再投	2024-04-16	1,066.01	1,066.01	-
13	申赎	2024-04-17	5,000,000.00	5,000,000.00	-
14	红利再投	2024-04-17	1,336.31	1,336.31	-
15	申赎	2024-04-18	5,000,000.00	5,000,000.00	-
16	红利再投	2024-04-18	1,591.04	1,591.04	-

17	申赎	2024-04-19	5,000,000.00	5,000,000.00	-
18	红利再投	2024-04-19	1,850.51	1,850.51	-
19	申赎	2024-04-22	5,000,000.00	5,000,000.00	-
20	红利再投	2024-04-22	6,273.69	6,273.69	-
21	申赎	2024-04-23	5,000,000.00	5,000,000.00	-
22	红利再投	2024-04-23	2,340.56	2,340.56	-
23	申赎	2024-04-24	5,000,000.00	5,000,000.00	-
24	红利再投	2024-04-24	3,380.68	3,380.68	-
25	申赎	2024-04-25	5,000,000.00	5,000,000.00	-
26	红利再投	2024-04-25	2,855.51	2,855.51	-
27	申赎	2024-04-26	5,000,000.00	5,000,000.00	-
28	红利再投	2024-04-26	3,105.79	3,105.79	-
29	申赎	2024-04-29	5,000,000.00	5,000,000.00	-
30	红利再投	2024-04-29	10,918.89	10,918.89	-
31	申赎	2024-04-30	5,000,000.00	5,000,000.00	-
32	红利再投	2024-04-30	3,664.18	3,664.18	-
33	红利再投	2024-05-06	23,537.64	23,537.64	-
34	红利再投	2024-05-07	3,774.11	3,774.11	-
35	申赎	2024-05-08	5,000,000.00	5,000,000.00	-
36	红利再投	2024-05-08	3,977.77	3,977.77	-
37	申赎	2024-05-09	5,000,000.00	5,000,000.00	-
38	红利再投	2024-05-09	4,286.63	4,286.63	-
39	申赎	2024-05-10	5,000,000.00	5,000,000.00	-
40	红利再投	2024-05-10	4,278.65	4,278.65	-
41	申赎	2024-05-13	5,000,000.00	5,000,000.00	-
42	红利再投	2024-05-13	13,852.87	13,852.87	-
43	申赎	2024-05-14	5,000,000.00	5,000,000.00	-
44	红利再投	2024-05-14	4,838.48	4,838.48	-
45	申赎	2024-05-15	5,000,000.00	5,000,000.00	-
46	红利再投	2024-05-15	5,066.92	5,066.92	-
47	申赎	2024-05-16	5,000,000.00	5,000,000.00	-
48	红利再投	2024-05-16	5,307.93	5,307.93	-
49	申赎	2024-05-17	5,000,000.00	5,000,000.00	-
50	红利再投	2024-05-17	5,905.45	5,905.45	-
51	红利再投	2024-05-20	17,554.38	17,554.38	-
52	申赎	2024-05-21	5,000,000.00	5,000,000.00	-
53	红利再投	2024-05-21	6,066.62	6,066.62	-
54	申赎	2024-05-22	5,000,000.00	5,000,000.00	-
55	红利再投	2024-05-22	5,848.01	5,848.01	-
56	申赎	2024-05-23	5,000,000.00	5,000,000.00	-
57	红利再投	2024-05-23	5,682.96	5,682.96	-
58	申赎	2024-05-24	5,000,000.00	5,000,000.00	-

59	红利再投	2024-05-24	6,231.09	6,231.09	-
60	申赎	2024-05-27	5,000,000.00	5,000,000.00	-
61	红利再投	2024-05-27	18,752.32	18,752.32	-
62	申赎	2024-05-28	5,000,000.00	5,000,000.00	-
63	红利再投	2024-05-28	7,336.80	7,336.80	-
64	申赎	2024-05-29	5,000,000.00	5,000,000.00	-
65	红利再投	2024-05-29	6,952.40	6,952.40	-
66	申赎	2024-05-30	5,000,000.00	5,000,000.00	-
67	红利再投	2024-05-30	6,953.01	6,953.01	-
68	红利再投	2024-05-31	7,123.89	7,123.89	-
69	红利再投	2024-06-03	22,088.91	22,088.91	-
70	红利再投	2024-06-04	7,258.63	7,258.63	-
71	红利再投	2024-06-05	7,598.01	7,598.01	-
72	申赎	2024-06-06	5,000,000.00	5,000,000.00	-
73	红利再投	2024-06-06	8,807.37	8,807.37	-
74	申赎	2024-06-07	5,000,000.00	5,000,000.00	-
75	红利再投	2024-06-07	7,370.69	7,370.69	-
76	红利再投	2024-06-11	37,417.66	37,417.66	-
77	申赎	2024-06-12	5,000,000.00	5,000,000.00	-
78	红利再投	2024-06-12	9,122.25	9,122.25	-
79	申赎	2024-06-13	5,000,000.00	5,000,000.00	-
80	红利再投	2024-06-13	8,141.18	8,141.18	-
81	申赎	2024-06-14	5,000,000.00	5,000,000.00	-
82	红利再投	2024-06-14	8,782.76	8,782.76	-
83	申赎	2024-06-17	5,000,000.00	5,000,000.00	-
84	红利再投	2024-06-17	25,676.83	25,676.83	-
85	申赎	2024-06-18	5,000,000.00	5,000,000.00	-
86	红利再投	2024-06-18	8,807.15	8,807.15	-
87	申赎	2024-06-19	5,000,000.00	5,000,000.00	-
88	红利再投	2024-06-19	9,032.93	9,032.93	-
89	申赎	2024-06-20	5,000,000.00	5,000,000.00	-
90	红利再投	2024-06-20	9,314.66	9,314.66	-
91	申赎	2024-06-21	5,000,000.00	5,000,000.00	-
92	红利再投	2024-06-21	9,572.59	9,572.59	-
93	申赎	2024-06-24	5,000,000.00	5,000,000.00	-
94	红利再投	2024-06-24	29,463.29	29,463.29	-
95	红利再投	2024-06-25	9,860.57	9,860.57	-
96	红利再投	2024-06-26	10,200.85	10,200.85	-
97	申赎	2024-06-27	5,000,000.00	5,000,000.00	-
98	红利再投	2024-06-27	10,279.02	10,279.02	-
99	申赎	2024-06-28	5,000,000.00	5,000,000.00	-
100	红利再投	2024-06-28	10,667.38	10,667.38	-

合计			1,143,750,094.19	-702,837,887.03
----	--	--	------------------	-----------------

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 7 月 19 日