

景顺长城货币市场证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 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：2015 年 8 月 29 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。本半年度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 2015 年 8 月 27 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 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 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 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 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..... | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 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..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| §7 投资组合报告 | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 35 |
| 7.2 债券回购融资情况..... | 36 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 36 |
| 7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 37 |
| 7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细..... | 37 |
| 7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离..... | 37 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 38 |
| 7.8 投资组合报告附注..... | 38 |
| §8 基金份额持有人信息 | 39 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 39 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 39 |
| 8.3 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的情况..... | 39 |

| | |
|---------------------------------------|-----------|
| §9 开放式基金份额变动 | 39 |
| §10 重大事件揭示 | 40 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 40 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 40 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 41 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 42 |
| 10.9 其他重大事件..... | 42 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 45 |
| §12 备查文件目录 | 46 |
| 12.1 备查文件目录..... | 46 |
| 12.2 存放地点..... | 46 |
| 12.3 查阅方式..... | 46 |

§ 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 | |
| 交易代码 | 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 | 景顺长城动力平衡混合(260103)、景顺长城优选股票(260101) | |
| 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 | 1,990,652,514.70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 | 375,599,948.08份 | 1,615,052,566.62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 | 杨崑阳 | 王永民 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 | 010-66594896 |
| | 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 | 赵如冰 | 田国立 |

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、上海证券报、证券时报 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.igwfm.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 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

| 基金级别 | 景顺长城货币 A | 景顺长城货币 B |
|---------------|--|--|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日) | 报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 8,434,931.66 | 18,630,480.47 |
| 本期利润 | 8,434,931.66 | 18,630,480.47 |
| 本期净值收益率 | 1.9211% | 2.0427% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015 年 6 月 30 日) | |
| 期末基金资产净值 | 375,599,948.08 | 1,615,052,566.62 |
| 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(2015 年 6 月 30 日) | |
| 累计净值收益率 | 30.3461% | 18.6750% |

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，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、货币基金的收益分配方式为按月结转份额。

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

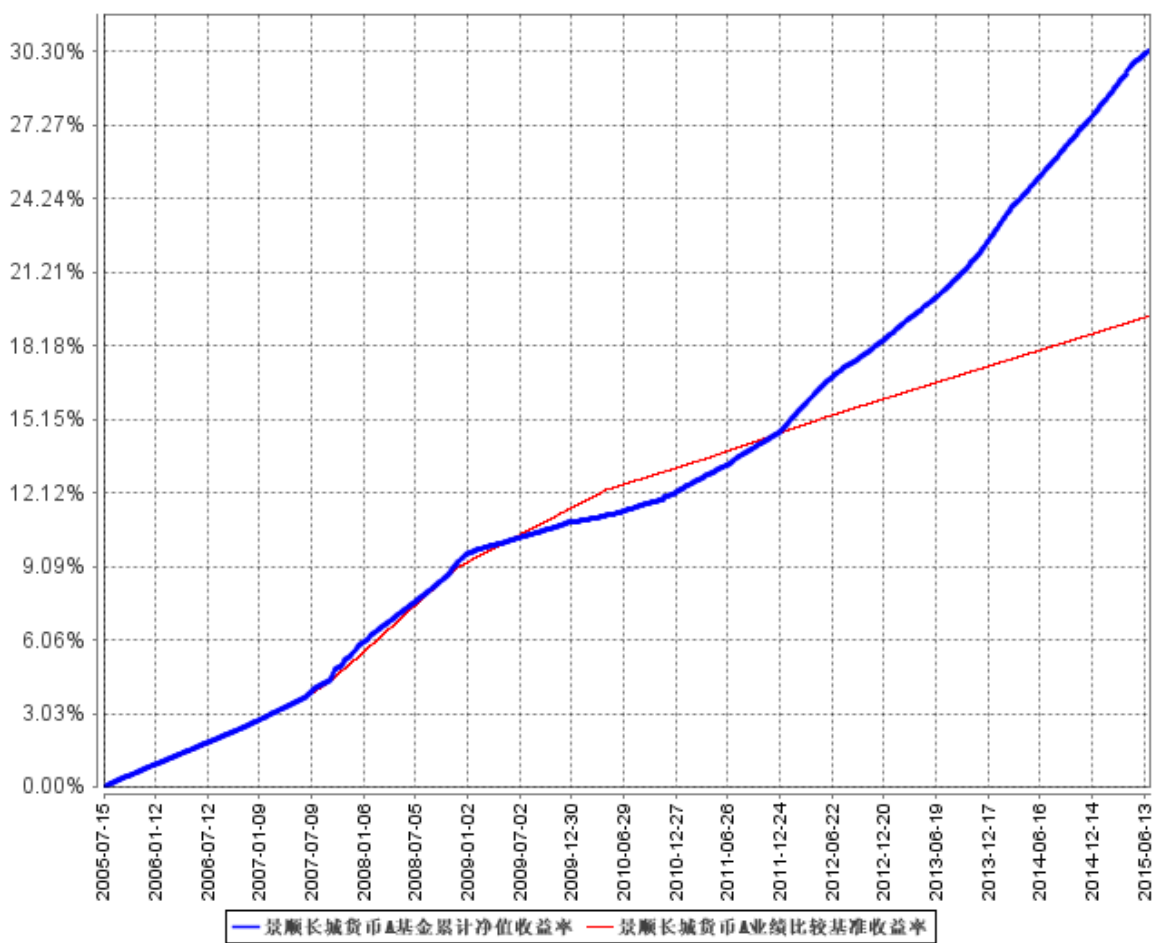
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去一个月 | 0.2306% | 0.0050% | 0.1110% | 0.0000% | 0.1196% | 0.0050% |
| 过去三个月 | 0.8607% | 0.0125% | 0.3366% | 0.0000% | 0.5241% | 0.0125% |
| 过去六个月 | 1.9211% | 0.0108% | 0.6695% | 0.0000% | 1.2516% | 0.0108% |
| 过去一年 | 3.9688% | 0.0088% | 1.3500% | 0.0000% | 2.6188% | 0.0088% |
| 过去三年 | 11.4181% | 0.0067% | 4.0505% | 0.0000% | 7.3676% | 0.0067% |
| 自基金运作起始日至今 | 30.3461% | 0.0067% | 19.4057% | 0.0022% | 10.9404% | 0.0045% |

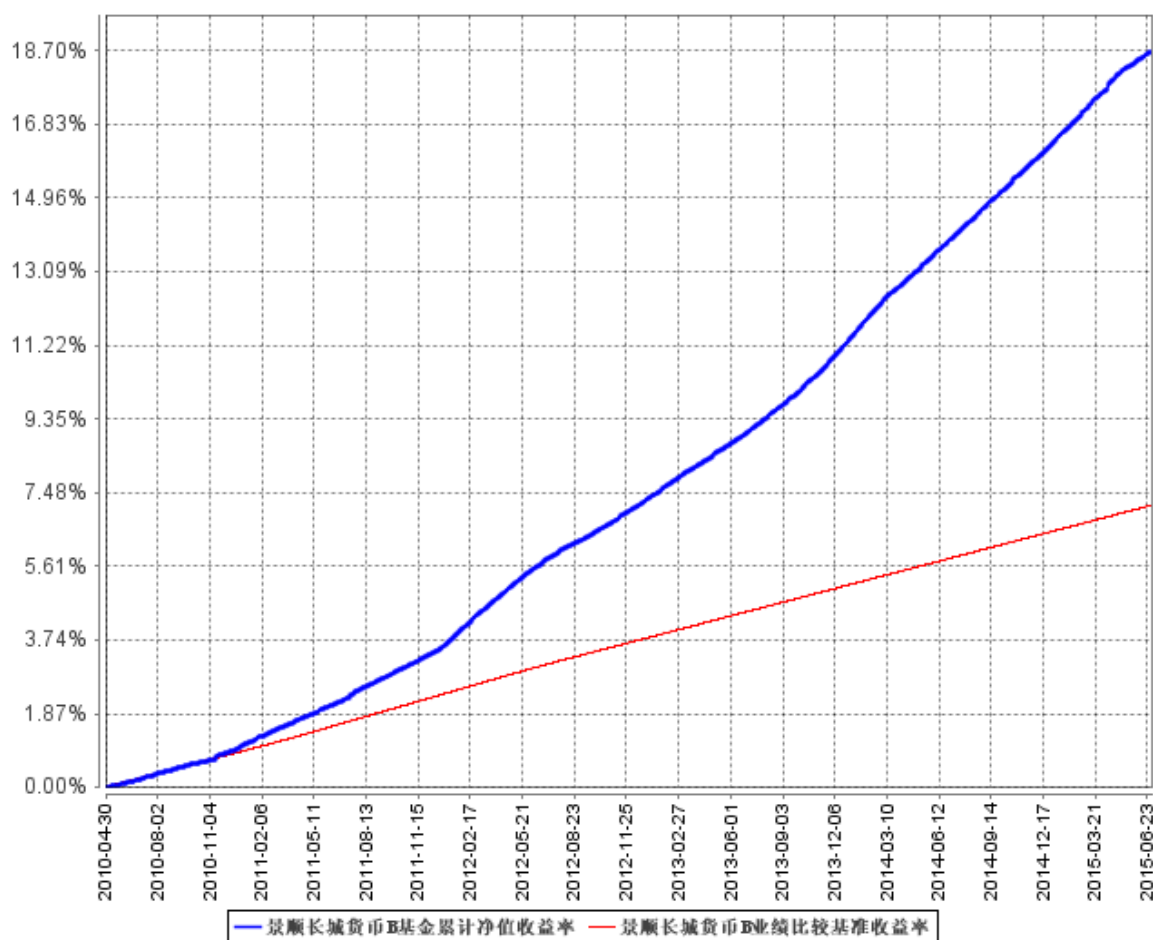
景顺长城货币 B

| 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 | 0.2503% | 0.0050% | 0.1110% | 0.0000% | 0.1393% | 0.0050% |
| 过去三个月 | 0.9210% | 0.0125% | 0.3366% | 0.0000% | 0.5844% | 0.0125% |
| 过去六个月 | 2.0427% | 0.0108% | 0.6695% | 0.0000% | 1.3732% | 0.0108% |
| 过去一年 | 4.2178% | 0.0088% | 1.3500% | 0.0000% | 2.8678% | 0.0088% |
| 过去三年 | 12.2197% | 0.0067% | 4.0505% | 0.0000% | 8.1692% | 0.0067% |
| 自基金分级起至今 | 18.6750% | 0.0067% | 7.1568% | 0.0002% | 11.5182% | 0.0065% |

注：本基金的收益分配为每日分配，按月结转份额。

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





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“公司”或“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。

截止 2015 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 46 只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金、景顺长城公司治理股票型证券投资基金、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、景顺长城中小盘股票型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华股票型证券投资基金、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业股票型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证 800 食品饮料交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选股票证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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 | | |
| 毛从容 | 景顺长城稳健回报灵活配置混合型基金、 | 2005 年 6 月 1 日 | - | 15 | 经济学硕士。曾任职于交通银行、长城证券金 |

| | | | | | |
|-----|---|------------------|----------------|----|---|
| | 领先回报灵活配置混合型基金、中国回报灵活配置混合型基金、安享回报灵活配置混合型基金、鑫月薪定期支付债券型基金、景颐双利债券型基金、景丰货币市场基金、景系列基金经理（分管景系列基金下设之景顺长城货币市场基金），固定收益部投资总监 | | | | 融研究所，着重于宏观和债券市场的研究，并担任金融研究所债券业务小组组长。2003 年 3 月加入本公司，担任研究员等职务；自 2005 年 6 月起担任基金经理。 |
| 张继荣 | 景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）基金经理，景系列基金经理（分管景系列基金下设之景顺长城动力平衡证券投资基金），景顺长城优质成长股票型证券投资基金基金经理，研究部总监 | 2014 年 1 月 16 日 | - | 15 | 工学博士。曾担任大鹏证券行业分析师，融通基金研究员、研究策划部总监助理、基金经理，银华基金投资管理部策略分析师、基金经理等职务。2009 年 3 月加入本公司，自 2009 年 8 月起担任基金经理。 |
| 陈嘉平 | 景系列基金经理（分管景系列基金下设之景顺长城优选股票证券投资基金），景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金经理，股票投资部投资副总监 | 2012 年 1 月 17 日 | 2015 年 4 月 3 日 | 14 | 商学硕士，CFA。曾在台湾先后担任兆丰金控兆丰证券股份有限公司经济研究本部襄理、宝来证券投资信托股份有限公司总经理室副理、德盛安联证券投资信托股份有限公司投资管理部基金经理、金复华证券投资信托股份有限公司投资研究部资深副理；2007 年 11 月至 2010 年 6 月担任本公司国际投资部高级经理职务。2010 年 12 月重新加入本公司，历任研究员、资深研究员等职务；自 2011 年 12 月起担任基金经理。 |
| 杨锐文 | 景系列基金经理（分管景系列基金下设之景顺长城优选股 | 2014 年 10 月 25 日 | - | 5 | 工学硕士、理学硕士。曾担任上海常春藤衍生投资公司高级分析师。 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | 票证券投资基金),景 顺长城成长之星股票 型证券投资基金基金 经理 | | | | 2010 年 11 月加入本公 司,担任研究员职务; 自 2014 年 10 月起担任 基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

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;

3、毛从容女士于 2015 年 4 月 2 日离任景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金经理;

4、陈嘉平先生于 2015 年 4 月 3 日离任景系列基金(分管景系列基金下设之景顺长城优选股票证券投资基金)、景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金经理。

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》、《证券投资基金销售管理办法》和《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

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

本报告期内,本基金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 1 次,为公司旗下景顺长城量化精选股票型基金根据基金合同约定通过量化模型建仓从而与其他组合发生的反向交易。

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

2015 年上半年 GDP 增速为 7%，比 2014 年同期回落 0.4 个百分点。其中工业增加值从 3 月最低的 5.6%，增速回升到 6 月的 6.8%。6 月固定资产投资增速累计同比是 11.4%，与 1-5 月持平，投资增速下滑态势得到抑制。1-6 月社会消费品零售总额累计同比 10.4%，较 2014 年同期有所下降，处于近十年的历史低位。经济数据呈现温和企稳态势，包括 PMI、工业增加值、固定资产投资、房地产开发投资等数据在 6 月份均有触底回升迹象。尽管猪肉价格持续上升，但 4、5 月份的 CPI 一直保持低位，通胀压力不大。社融与信贷增长仍旧低迷，显示信用扩张依旧不力。

期间货币政策持续宽松，经过 3 次降息、3 次降准，公开市场连续降低逆回购利率引导市场，并配合巨量 PSL 操作降低长端利率，意图降低实体经济融资成本。但由于信用传导不畅，过多的流动性淤积在银行间市场，资金面非常宽松。央行 5 月中下旬重启定向正回购，货币政策基调已逐渐由前期的总量放松逐渐转变为“锁短放长”和“定向放松”。受基本面和政策面的影响，债券收益率整体下行。短端下行幅度较大，长期利率因市场忧虑经济反弹及地方债供给压力，下行幅度较小。截止 2015 年 6 月末，与年初相比，1 年期国开债下行 117BP 至 2.78%，10 年期国开债为 4.1%与年初持平。信用债收益率及利差下行幅度较大，1 年期 AA 短融、3 年期 AA 中票、3 年期 AA 城投债分别下行 128BP、67BP 和 77BP 至 4.35%、5.00%和 5.08%。

资金面方面，1 季度受 IPO 打新收益高企影响，短端资金利率下行不明显。4 月份央行降准力度超市场预期，加上公开市场逆回购利率持续下行，2 季度资金利率下行明显，至 5 月中旬，银行间隔夜回购利率跌破 1%，7 天回购利率回落至 2%以内。由于货币政策结构调整，加上新股发行规模上升以及半年末结帐因素，6 月份资金利率有所回升。

本基金上半年考虑到新股发行加速，短端市场利率方向下行，组合剩余期限先拉长加大短融和利率债配置，5 月份后资金已经达到最宽松的时候，操作上压缩久期，类别资产配置上关注半年末存款和跨期回购的交易机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年上半年，景顺货币 A 份额净值收益率为 1.9211%，高于业绩比较基准收益率 1.2516%；景顺货币 B 份额净值收益率为 2.0427%，高于业绩比较基准收益率 1.3732%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然未来经济企稳的概率比较大，但是时点可能在 3 季度末。通胀在年内应该不是风险因素。从稳增长角度政策短期内还将以偏宽松为主，考虑到美联储可能的加息未来我们降准的可能性较

大。展望 2015 年第 3 季度的债券市场，基本面和政策面决定债券市场方向将不变，二级市场股票的剧烈波动、新股 IPO 的收益率收窄，资金面的角度对债券市场相对有利。在政策没有转向之前我们认为短端资金利率会维持低位。预计 7 天回购利率的波动区间会在 2.2-2.5%。策略上，剩余期限维持在较低水平，关注新股扰动时的机会，根据类别资产收益率的变化和相对吸引力进行动态调整。

本基金将坚持一贯以来的稳健操作风格，强化投资风险控制，密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况，持续保持对组合的信用风险和流动性风险的关注，努力为投资人创造安全稳定的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立基金估值小组对基金财产的估值方法及估值程序作决策，基金估值小组在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值意见及独立第三方机构估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，以求公平对待投资者。

估值小组成员包括公司投资片、交易管理部、基金事务部、法律、监察稽核部、风险管理岗等相关人员。

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，基金托管人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、适用性的情况时，通过会议方式启动估值小组的运作。对长期停牌股票等没有市价的投资品种，由投资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、行业发展及个股状况等各方面因素，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小组提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据投资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小组。估值小组共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值小组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，并对有关信息披露文件进行合规性审查。

基金估值小组核心成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理在需要时出席估值小组会议，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，向估值小组提出估值建议。估值小组将充分考虑基金经理的意见和建议，确定估值方法。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

估值小组秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。

本基金参与估值流程的各方之间不存在任何重大的利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其提供银行间同业市场交易的债券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

根据本基金合同约定，本基金的收益分配方式为按月结转份额。

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、基金份额申购赎回价格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 托管人对本半年度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”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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 515,288,340.18 | 733,659,459.81 |
| 结算备付金 | | 2,895,000.00 | 3,377,500.00 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 750,802,695.38 | 720,663,860.85 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 750,802,695.38 | 720,663,860.85 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 622,902,734.35 | 1,180,403,715.60 |
| 应收证券清算款 | | - | 66,399.88 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 11,673,388.05 | 21,608,503.98 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 92,480,346.43 | 2,622,850.46 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,996,042,504.39 | 2,662,402,290.58 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 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 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 2,911,159.11 | 592,863.00 |
| 应付管理人报酬 | | 357,217.28 | 392,888.24 |
| 应付托管费 | | 108,247.68 | 119,057.03 |
| 应付销售服务费 | | 81,151.78 | 102,448.23 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 27,485.41 | 15,257.97 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应交税费 | | 59,200.00 | 59,200.00 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | 1,712,291.08 | 2,959,600.98 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 133,237.35 | 136,670.93 |
| 负债合计 | | 5,389,989.69 | 4,377,986.38 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,990,652,514.70 | 2,658,024,304.20 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 1,990,652,514.70 | 2,658,024,304.20 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,996,042,504.39 | 2,662,402,290.58 |

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,990,652,514.70 份。其中 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 375,599,948.08 份；B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,615,052,566.62 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | 30,840,591.97 | 42,086,023.81 |
| 1.利息收入 | | 30,056,176.14 | 39,562,707.40 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 8,285,886.03 | 19,452,371.21 |
| 债券利息收入 | | 14,115,100.95 | 16,003,450.12 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 7,655,189.16 | 4,106,886.07 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 784,415.83 | 2,523,316.41 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 784,415.83 | 2,523,316.41 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | - | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 列) | | | |
| 减：二、费用 | | 3,775,179.84 | 4,512,696.00 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 2,292,316.06 | 2,793,292.43 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 694,641.17 | 846,452.21 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 597,817.35 | 546,295.11 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | - | - |
| 5. 利息支出 | | 37,224.30 | 175,311.61 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 37,224.30 | 175,311.61 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.19 | 153,180.96 | 151,344.64 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 27,065,412.13 | 37,573,327.81 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 27,065,412.13 | 37,573,327.81 |

6.3 所有者权益(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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|----------------|-------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 2,658,024,304.20 | - | 2,658,024,304.20 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 27,065,412.13 | 27,065,412.13 |
| 三、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) | -667,371,789.50 | - | -667,371,789.50 |
| 其中：1. 基金申购款 | 6,101,707,761.43 | - | 6,101,707,761.43 |
| 2. 基金赎回款 | -6,769,079,550.93 | - | -6,769,079,550.93 |
| 四、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) | - | -27,065,412.13 | -27,065,412.13 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,990,652,514.70 | - | 1,990,652,514.70 |
| 项目 | 上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |

| | | | |
|--|-------------------|----------------|-------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,966,110,340.30 | - | 1,966,110,340.30 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 37,573,327.81 | 37,573,327.81 |
| 三、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) | -856,702,053.37 | - | -856,702,053.37 |
| 其中:1.基金申购款 | 4,526,468,539.76 | - | 4,526,468,539.76 |
| 2.基金赎回款 | -5,383,170,593.13 | - | -5,383,170,593.13 |
| 四、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) | - | -37,573,327.81 | -37,573,327.81 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,109,408,286.93 | - | 1,109,408,286.93 |

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:

_____ 许义明 _____
_____ 吴建军 _____
_____ 邵媛媛 _____
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 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《货币市场基金管理暂行规定》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, 一年以内的银行定期存款、大额存单, 剩余期限在 397 天以内的债券, 期限在一年以内的债券回购, 期限在一年以内的中央银行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 2015 年 8 月 27 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其相关规定(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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 上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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和基金净值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

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。

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

无。

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》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(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。

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 2015年6月30日 |
|----------------|-------------------|
| 活期存款 | 22,288,340.18 |
| 定期存款 | 493,000,000.00 |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | 493,000,000.00 |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 515,288,340.18 |

注：1. 定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

2. 本基金本期末未发生定期存款提前支取的情况。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2015年6月30日 | | | |
|----|-------|-------------------|----------------|--------------|---------|
| | | 摊余成本 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | 750,802,695.38 | 753,013,000.00 | 2,210,304.62 | 0.1110% |
| | 合计 | 750,802,695.38 | 753,013,000.00 | 2,210,304.62 | 0.1110% |

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末的衍生金融资产/负债项目余额为零。

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 2015年6月30日 | |
|------------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_银行间 | 622,902,734.35 | - |

| | | |
|----|----------------|---|
| 合计 | 622,902,734.35 | - |
|----|----------------|---|

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,405.65 |
| 应收定期存款利息 | 287,694.45 |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 1,172.52 |
| 应收债券利息 | 10,842,993.07 |
| 应收买入返售证券利息 | 540,122.36 |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 11,673,388.05 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末的其他资产余额为零。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 27,485.41 |
| 合计 | 27,485.41 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 30,163.96 |
| 预提费用 | 103,073.39 |
| 合计 | 133,237.35 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 景顺长城货币 A | | |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 888,288,980.02 | 888,288,980.02 |
| 本期申购 | 1,567,741,878.91 | 1,567,741,878.91 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -2,080,430,910.85 | -2,080,430,910.85 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 375,599,948.08 | 375,599,948.08 |

金额单位：人民币元

| 景顺长城货币 B | | |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,769,735,324.18 | 1,769,735,324.18 |
| 本期申购 | 4,533,965,882.52 | 4,533,965,882.52 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -4,688,648,640.08 | -4,688,648,640.08 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 1,615,052,566.62 | 1,615,052,566.62 |

注：申购含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调减份额。

6.4.7.10 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 |
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期利润 | 8,434,931.66 | - | 8,434,931.66 |
| 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 | -8,434,931.66 | - | -8,434,931.66 |
| 本期末 | - | - | - |

单位：人民币元

| 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 |
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期利润 | 18,630,480.47 | - | 18,630,480.47 |
| 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 | -18,630,480.47 | - | -18,630,480.47 |
| 本期末 | - | - | - |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 53,625.96 |
| 定期存款利息收入 | 8,211,588.92 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 20,671.15 |
| 其他 | - |
| 合计 | 8,285,886.03 |

6.4.7.12 股票投资收益

不适用。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,259,395,390.88 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,220,343,765.21 |
| 减：应收利息总额 | 38,267,209.84 |
| 买卖债券差价收入 | 784,415.83 |

6.4.7.14 衍生工具收益

不适用。

6.4.7.15 股利收益

不适用。

6.4.7.16 公允价值变动收益

不适用。

6.4.7.17 其他收入

本基金本期其他收入项目发生额为零。

6.4.7.18 交易费用

本基金本期交易费用项目发生额为零。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 审计费用 | 44,630.98 |
| 信息披露费 | 49,588.57 |
| 债券托管账户维护费 | 18,053.84 |
| 银行划款手续费 | 40,907.57 |
| 合计 | 153,180.96 |

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，本基金并无需作披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

| 2015 年度 | 宣告日 | 分配收益所属期间 |
|--------------|------------|-----------------------|
| —第 7 号收益支付公告 | 2015/07/15 | 2015/06/15-2015/07/14 |
| —第 8 号收益支付公告 | 2015/08/17 | 2015/07/15-2015/08/16 |

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、注册登记机构、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 债券回购交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 | | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 | |
|-------|----------------------------|----------------|---------------------------------|----------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 长城证券 | 1,770,000,000.00 | 100.00% | 5,990,000,000.00 | 100.00% |

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

本基金本报告期和上年度可比期间未发生关联方佣金支出。

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 2015年1月1日至2015年6月30日 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,292,316.06 | 2,793,292.43 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 324,489.95 | 261,156.99 |

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 0.33% 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 X 0.33% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 694,641.17 | 846,452.21 |

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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 X 0.1% / 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 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 | 24,754.87 | 40,510.22 | 65,265.09 |
| 中国银行 | 36,616.13 | 498.55 | 37,114.68 |
| 长城证券 | 2,077.69 | 75.29 | 2,152.98 |
| 合计 | 63,448.69 | 41,084.06 | 104,532.75 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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 | 51,936.23 | 61,411.83 | 113,348.06 |
| 中国银行 | 54,876.27 | 1,082.38 | 55,958.65 |
| 长城证券 | 1,218.71 | 57.78 | 1,276.49 |
| 合计 | 108,031.21 | 62,551.99 | 170,583.20 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日对应级别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 级基金份额和 B 级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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------------------------------|--------|-------|-------|
| 银行间市场 | 债券交易金额 | 基金逆回购 | 基金正回购 |
| | | | |

| 交易的各关联方名称 | 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 | - | - | - | - | 75,078,000.00 | 2,685.29 |
| 上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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 | 51,436,878.08 | 20,600,919.18 | - | - | 284,800,000.00 | 22,642.34 |

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固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

景顺长城货币 A

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2014 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 |
| 景顺资产管理有限公司 | - | - | - | - |

景顺长城货币 B

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2014 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 |
| 景顺资产管理有限公司 | 47,158,994.68 | 2.92% | - | - |

注：关联方持有的基金份额占基金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。

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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-活期 | 22,288,340.18 | 53,625.96 | 3,511,747.79 | 69,265.56 |
| 中国银行-定期 | 400,000,000.00 | 194,444.44 | - | - |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息，存入中国银行的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

本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：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 |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 6,829,056.73 | 2,201,297.20 | -595,422.27 | 8,434,931.66 | A级 |

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 |
|---------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 13,260,541.01 | 6,021,827.09 | -651,887.63 | 18,630,480.47 | B级 |

注：本基金的基金管理人于资产负债表日后，报告批准报出日前宣告的利润分配情况，请参见附注 6.4.8.2 资产负债表日后事项。

6.4.12 期末（2015 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/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末无暂时停牌等流通受限的股票。

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

截至本报告期末，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本期末，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

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

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标，并达到确保合法合规经营、防范和化解风险、提高经营效率及保护投资者和股东合法权益的目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由法律监察稽核部负责，投资风险分析与绩效评估由独立的投资风险评估人员负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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约责任，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情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。其他定期存款存放在具有托管资格的中国银行、中国民生银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在证券交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期

信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 32.18%(2014 年 12 月 31 日：19.59%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资于一家公司发行的短期企业债券的比例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%。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 180 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。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的 20%。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的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。

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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2015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 | 515,288,340.18 | - | - | - | - | - | 515,288,340.18 |
| 结算备付金 | 2,895,000.00 | - | - | - | - | - | 2,895,000.00 |
| 交易性金融资产 | 370,166,144.27 | 250,383,512.33 | 130,253,038.78 | - | - | - | 750,802,695.38 |
| 买入返售金融资产 | 622,902,734.35 | - | - | - | - | - | 622,902,734.35 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 11,673,388.05 | 11,673,388.05 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 92,480,346.43 | 92,480,346.43 |
| 资产总计 | 1,511,252,218.80 | 250,383,512.33 | 130,253,038.78 | - | - | 104,153,734.48 | 1,996,042,504.39 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 2,911,159.11 | 2,911,159.11 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 357,217.28 | 357,217.28 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 108,247.68 | 108,247.68 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 81,151.78 | 81,151.78 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 27,485.41 | 27,485.41 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 59,200.00 | 59,200.00 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | 1,712,291.08 | 1,712,291.08 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 133,237.35 | 133,237.35 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 5,389,989.69 | 5,389,989.69 |
| 利率敏感度缺口 | 1,511,252,218.80 | 250,383,512.33 | 130,253,038.78 | - | - | - | - |
| 上年度末 2014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 | 733,659,459.81 | - | - | - | - | - | 733,659,459.81 |
| 结算备付金 | 3,377,500.00 | - | - | - | - | - | 3,377,500.00 |
| 交易性金融资产 | 230,051,551.42 | 250,285,493.18 | 240,326,816.25 | - | - | - | 720,663,860.85 |
| 买入返售金融资产 | 1,180,403,715.60 | - | - | - | - | - | 1,180,403,715.60 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 66,399.88 | 66,399.88 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 21,608,503.98 | 21,608,503.98 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 2,622,850.46 | 2,622,850.46 |
| 资产总计 | 2,147,492,226.83 | 250,285,493.18 | 240,326,816.25 | - | - | 24,297,754.32 | 2,662,402,290.58 |

| | | | | | | | |
|---------|------------------|----------------|----------------|---|---|--------------|--------------|
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 592,863.00 | 592,863.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 392,888.24 | 392,888.24 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 119,057.03 | 119,057.03 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 102,448.23 | 102,448.23 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 15,257.97 | 15,257.97 |
| 应付税费 | - | - | - | - | - | 59,200.00 | 59,200.00 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | 2,959,600.98 | 2,959,600.98 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 136,670.93 | 136,670.93 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 4,377,986.38 | 4,377,986.38 |
| 利率敏感度缺口 | 2,147,492,226.83 | 250,285,493.18 | 240,326,816.25 | - | - | - | - |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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 | | |
| 分析 | 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（2015年6月30日） | 上年度末（2014年12月31日） |
| | 1. 市场利率下降 25 个基点 | 255,394.26 | 329,500.67 |
| | 2. 市场利率上升 25 个基点 | -254,582.36 | -328,494.19 |

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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素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，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，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中属于第二层次的余额为 750,802,695.38 元，无属于第一或第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第二层次 720,663,860.85 元，无属于第一或第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 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资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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 | 750,802,695.38 | 37.61 |
| | 其中：债券 | 750,802,695.38 | 37.61 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 622,902,734.35 | 31.21 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 518,183,340.18 | 25.96 |

| | | | |
|---|--------|------------------|--------|
| 4 | 其他各项资产 | 104,153,734.48 | 5.22 |
| 5 | 合计 | 1,996,042,504.39 | 100.00 |

注：银行存款和结算备付金中包含货币基金定期存款 493,000,000.00 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 | 0.43 | |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 22 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 61 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 18 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 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 180 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 | 75.92 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 10.06 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)—90 天 | 2.52 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |

| | | | |
|----|-------------------------|-------|---|
| 4 | 90 天(含)—180 天 | 5.03 | - |
| | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180 天(含)—397 天(含) | 1.52 | - |
| | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 95.04 | - |

7.4 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 | 摊余成本 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|----------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 110,265,282.08 | 5.54 |
| | 其中: 政策性金融债 | 110,265,282.08 | 5.54 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 640,537,413.30 | 32.18 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 750,802,695.38 | 37.72 |
| 9 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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) | 摊余成本 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|---------------|
| 1 | 011590004 | 15 苏交通 SCP004 | 600,000 | 60,129,423.36 | 3.02 |
| 2 | 071502004 | 15 国泰君安 CP004 | 500,000 | 50,051,184.55 | 2.51 |
| 3 | 011566001 | 15 中航机 SCP001 | 500,000 | 50,025,329.07 | 2.51 |
| 4 | 011537006 | 15 中建材 SCP006 | 500,000 | 50,013,629.81 | 2.51 |
| 5 | 071504004 | 15 广发 CP004 | 500,000 | 50,002,534.81 | 2.51 |
| 6 | 071503004 | 15 中信 CP004 | 500,000 | 50,002,376.19 | 2.51 |
| 7 | 140230 | 14 国开 30 | 400,000 | 39,995,489.02 | 2.01 |
| 8 | 150403 | 15 农发 03 | 300,000 | 30,193,458.86 | 1.52 |
| 9 | 011414008 | 14 中粮 SCP008 | 300,000 | 30,144,535.22 | 1.51 |
| 10 | 130326 | 13 进出 26 | 300,000 | 30,070,539.02 | 1.51 |

7.6 “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 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.2445% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0677% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1636% |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。本基金采用固定份额净值，基金份额净值恒定为 1.0000 元。

7.8.2

本报告期内，本基金未持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，也不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过基金资产净值 20%的情况。

7.8.3

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.8.4 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 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 11,673,388.05 |
| 4 | 应收申购款 | 92,480,346.43 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 104,153,734.48 |

§ 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 | 10,074 | 37,284.09 | 7,880,278.12 | 2.10% | 367,719,669.96 | 97.90% |
| 景顺长城货币 B | 20 | 80,752,628.33 | 1,587,718,199.82 | 98.31% | 27,334,366.80 | 1.69% |
| 合计 | 10,094 | 197,211.46 | 1,595,598,477.94 | 80.15% | 395,054,036.76 | 19.85% |

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 | 681.70 | 0.00% |
| | 景顺长城货币 B | - | 0.00% |
| | 合计 | 681.70 | 0.00% |

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金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）。

8.3 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的情况

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 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 | 81,561,919.51 | - |

| | | |
|--------------------------|------------------|------------------|
| 份额总额 | | |
| 本报告期期初基金份额总额 | 888,288,980.02 | 1,769,735,324.18 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,567,741,878.91 | 4,533,965,882.52 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 2,080,430,910.85 | 4,688,648,640.08 |
| 本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 375,599,948.08 | 1,615,052,566.62 |

注: 申购含红利再投、转换入及分级份额调增份额; 赎回含转换出及分级份额调减份额。

§ 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

1、本基金管理人于 2015 年 1 月 23 日发布公告, 经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过, 同意王鹏辉先生辞去本公司副总经理一职。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案。有关公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站上。

2、2015 年 4 月, 李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内, 无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

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 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |

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，最近两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 | - | - | 1,770,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

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 | 景顺长城货币市场证券投资基金收益支付公告（2015年第1号） | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015年1月15 日 |

| | | | |
|----|--|------------------------------|----------------|
| 2 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增苏州银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015年1月16 日 |
| 3 | 景顺长城货币市场证券投资基金2014年第4季度报告 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015年1月22 日 |
| 4 | 景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015年1月23 日 |
| 5 | 景顺长城货币市场证券投资基金关于“春节”假期前暂停申购及转换转入业务的公告 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015年2月12 日 |
| 6 | 景顺长城货币市场证券投资基金收益支付公告（2015年第2号） | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015年2月16 日 |
| 7 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增星展银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015年3月9 日 |
| 8 | 景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统基金转换费率优惠的公告 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015年3月9 日 |
| 9 | 景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统货币基金T+0快速赎回业务新增支持银行卡的公告 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015年3月11 日 |
| 10 | 景顺长城货币市场证券投资基金 | 中国证券报，上海证券报， | 2015年3月16 |

| | | | |
|----|--|------------------------------|--------------------|
| | 金收益支付公告（2015 年第 3 号） | 证券时报，基金管理人网站 | 日 |
| 11 | 景顺长城货币市场证券投资基金关于“清明”假期前暂停申购及转换转入业务的公告 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 3 月 30 日 |
| 12 | 景顺长城货币市场证券投资基金 2014 年年度报告 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 3 月 31 日 |
| 13 | 景顺长城货币市场证券投资基金 2014 年年度报告摘要 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 3 月 31 日 |
| 14 | 景顺长城货币市场证券投资基金收益支付公告（2015 年第 4 号） | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 4 月 15 日 |
| 15 | 景顺长城货币市场证券投资基金 2015 年第 1 季度报告 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 4 月 21 日 |
| 16 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增汇付金融为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 4 月 30 日 |
| 17 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增利得基金为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”的公告 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 5 月 8 日 |
| 18 | 景顺长城货币市场证券投资基金收益支付公告（2015 年第 5 号） | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 5 月 15 日 |
| 19 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在花旗银行开通基金“定期定额投资业务” | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 5 月 21 日 |

| | | | |
|----|--|------------------------------|----------------|
| | 的公告 | | |
| 20 | 景顺长城基金管理有限公司关于暂停网上直销交易系统快速赎回业务的公告 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015年5月23 日 |
| 21 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增川财证券为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015年5月29 日 |
| 22 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增天风证券为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015年6月4 日 |
| 23 | 景顺长城景系列开放式证券投资基金 2015 年第 1 号更新招募说明书摘要 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015年6月8 日 |
| 24 | 景顺长城景系列开放式证券投资基金 2015 年第 1 号更新招募说明书 | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015年6月8 日 |
| 25 | 景顺长城货币市场证券投资基金收益支付公告（2015 年第 6 号） | 中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站 | 2015年6月15 日 |

§ 11 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、中国证监会批准景顺长城景系列开放式证券投资基金设立的文件；
- 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
2015年8月29日