

景顺长城交易型货币市场基金 2016 年半年 度报告

2016 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：中国银河证券股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
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.....	13
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.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 债券回购融资情况.....	31
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	31
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.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	32
7.6 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.....	33
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	33
7.8 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.....	33
7.9 投资组合报告附注.....	34
§8 基金份额持有人信息	34

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	35
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	35
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的情况.....	35
§9 开放式基金份额变动.....	35
§10 重大事件揭示.....	36
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变.....	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	37
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.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	38
10.9 其他重大事件.....	38
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	39
§12 备查文件目录.....	39
12.1 备查文件目录.....	39
12.2 存放地点.....	39
12.3 查阅方式.....	39

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城交易型货币市场基金
基金简称	景顺长城货币 ETF
场内简称	景顺货币
基金主代码	511890
交易代码	511890
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 16 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	23,632,076.88 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 8 月 3 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产相对低风险和相对高流动性的前提下，追求高于业绩比较基准的回报。
投资策略	<p>1. 整体资产久期策略</p> <p>本基金根据对未来利率变动的合理预判，结合基金未来现金流的综合预期，以及投资者行为分析，动态决定和调整投资组合平均剩余期限。</p> <p>2. 类属配置策略</p> <p>类属配置是指基金组合在国债、央行票据、债券回购、金融债、短期融资券及现金等投资品种之间的配置比例。实现基金流动性需求并获得投资收益。</p> <p>3. 个券选择策略</p> <p>在个券选择层面，将首先考虑安全性和流动性因素，优先选择高信用等级的流动性好的债券品种以规避违约风险和流动性风险。</p> <p>4. 套利策略</p> <p>由于市场环境差异、交易市场分割、市场参与者差异、资金供求失衡、流动性等因素造成不同交易市场或不同交易品种出现定价差异现象，从而使债券市场上存在套利机会。在保证安全性和流动性的前提下，本基金将在充分验证这种套利机会可行性的基础上，适当参与市场的套利，捕捉和把握无风险套利机会，以获取安全的超额收益。</p> <p>5. 回购策略</p>

	<p>(1) 息差放大策略：该策略是指利用回购利率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益的投资策略。</p> <p>(2) 逆回购策略：基金管理人将密切关注合适的短期资金需求激增的机会，通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。</p> <p>6. 流动性管理策略</p> <p>本基金将保持高流动性的特性，将建立流动性预警指标，动态调整基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例。同时，密切关注本基金申购/赎回、季节性资金流动、新股申购、日历效应等情况，适时通过现金留存、提高流动性券种比例等方式提高基金资产整体的流动性，提升基金资产的整体变现能力。</p>
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的较低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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	中国银河证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	孟波
	联系电话	0755-82370388	010-83574679
	电子邮箱	investor@igwfm.com	yhqz_tggz@chinastock.com.cn
客户服务电话		4008888606	4008888888
传真		0755-22381339	010-66568532
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	中国北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层
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	中国北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
邮政编码		518048	100033
法定代表人		杨光裕	陈有安

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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	22,400,636.44
本期利润	22,400,636.44
本期净值收益率	1.1383%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	2,363,207,687.59
期末基金份额净值	100.00
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	2.0318%

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。

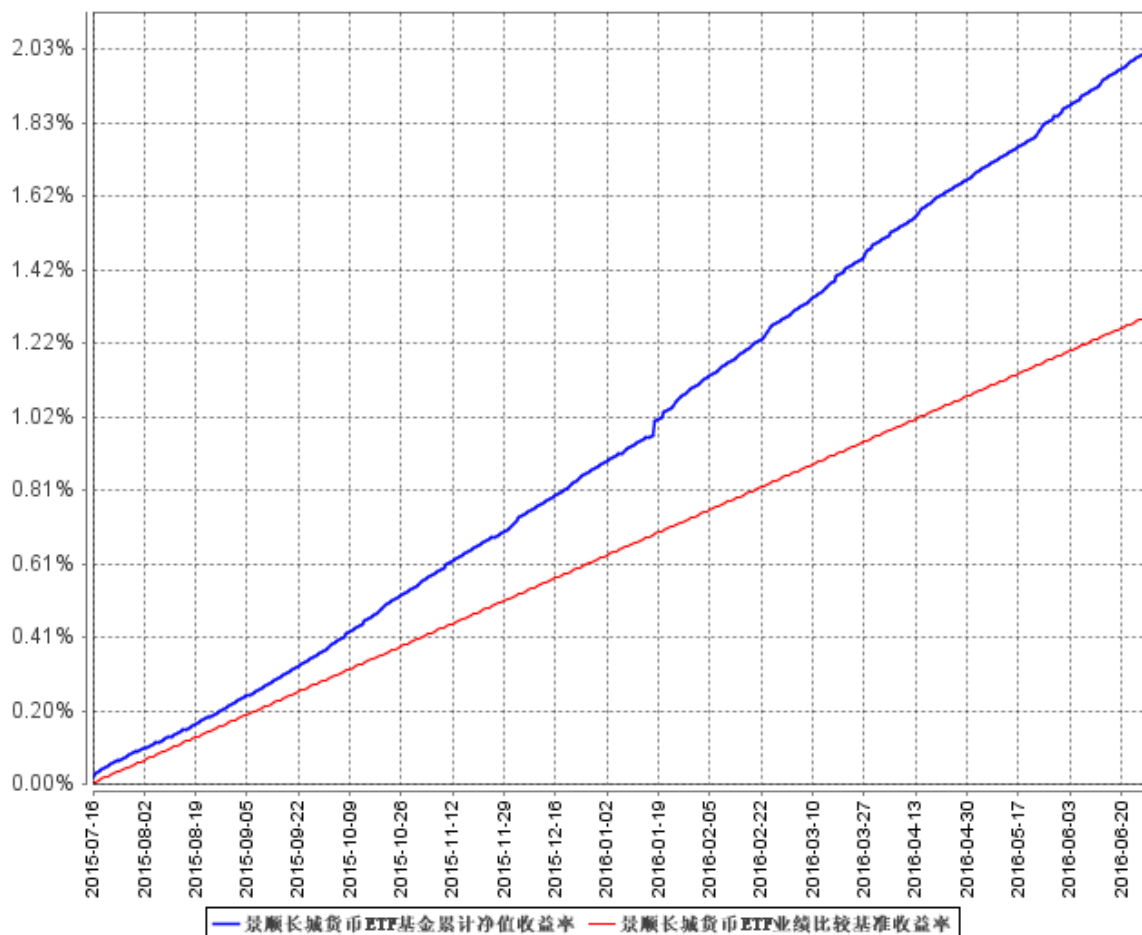
3、货币基金的收益分配方式为按日结转份额。

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

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	0.1757%	0.0021%	0.1107%	0.0000%	0.0650%	0.0021%
过去三个月	0.5311%	0.0021%	0.3357%	0.0000%	0.1954%	0.0021%
过去六个月	1.1383%	0.0034%	0.6713%	0.0000%	0.4670%	0.0034%
自基金合同生效起至今	2.0318%	0.0028%	1.2964%	0.0000%	0.7354%	0.0028%

3.2.2 自基金合同生效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：本基金的建仓期为 2015 年 7 月 16 日基金合同生效日起 3 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。基金合同生效日（2015 年 7 月 16 日）起至本报告期末不满一年。

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“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 2016 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 55 只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金、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、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、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、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、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、景顺长城交易型货币市场基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐增利债券型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金。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混合型

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		
袁媛	景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城交易型货币市场基金、景顺长城景颐增利债券型证券投资基金基金经理	2015年7月16日	-	9	经济学硕士。曾任职于齐鲁证券北四环营业部，也曾担任中航证券证券投资部投资经理、安信证券资产管理部投资主办等职务。2013年7月加入本公司，担任固定收益部资深研究员；自2014年4月起担任基金经理。
成念良	景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城交易型货币市场基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金基金经理	2015年12月11日	-	7	管理学硕士。曾担任大公国际资信评级有限公司评级部高级信用分析师，平安大华基金投研部信用研究员、专户业务部投资经理。2015年9月加入本公司，自2015年12月起担任固定收益部基金经理。

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”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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《景顺长城交易型货币市场基金基金合同》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。

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

经济数据方面，上半年中采制造业 PMI 指数先抑后扬，1、2 月份受经济下行压力低于 50 荣枯线，在 3 月份稳增长政策刺激下 PMI 突破 50 并在 2 季度持续，恢复到去年年中水平。今年 1-5 月固定资产投资增长 9.6%，较 1-4 月大幅回落 0.9%，主因是制造业投资大幅回落。民间投资大幅下滑 1.3%至 3.9%，占全部投资的比重较去年同期下滑 3.4%为 62.0%。5 月工业增加值同比增长 6.0%，增速与上月持平，比上年同期回落 0.1 个百分点。1-5 月社会消费品零售总额累计同比增速 10.2%，较 1-4 月下滑 0.1 个百分点。1-5 月份规模以上工业企业利润总额同比增长 6.4%，较前值回落 0.1 个百分点。1-5 月财政收入同比增长 8.3%，财政支出累计同比增长 13.6%，其中民生相关支出增长较快。

随着食品价格季节性走弱，预计 CPI 将继续小幅回落。大宗商品价格上涨以及基建投资加码对 PPI 形成支撑，上述影响因素仍未消除，后期 PPI 则可能继续改善。企业降杠杆需要政府加杠杆对冲，预计基建投资仍将继续维持高位。房地产投资开始走弱，而制造业投资持续放缓。民间投资今年以来加速下滑，制约投资总量增长，反映经济内生动力依然不足。经济依然向下令消费也随之整体疲弱。伴随政府托底经济政策，预计财政支出继续发力。

货币政策方面，央行并未进一步全面宽松，而是连续进行公开市场投放，6 月末 MPA 考核的冲击明显弱于 3 月末。美元走强导致人民币兑美元汇率面临一定的贬值压力，特别是英国“脱欧”后人民币兑美元汇率贬值幅度大幅上升。

金融数据方面，今年 1-5 月累计新增人民币贷款 6.15 万亿，同比多增 8683 亿。其中 1 月新增贷款 2.51 万亿，创历史单月新高。1-5 月新增社会融资总量 8.1 万亿，同比多增达 1.2 亿，主要受到人民币新增贷款和企业债券融资规模上涨导致，票据融资则受到严格监管大幅下滑。今年 1-5 月 M2 持续回落，主要由于高基数的影响。M1 的同比增速达持续攀升至 5 月份的 23.7%，与 M2

的剪刀差继续扩大。

上半年的 1 季度政策重心在稳经济，社融以及信贷增幅较大；2 季度随着供给侧改革重回政策重心，信贷和社融增速有所回落。4 月、5 月新增贷款乏力，主要靠居民中长期按揭贷款拉动，企业贷款需求则明显不足。社融主要受到企业债净发行量减少、票据融资大幅下滑影响。由于信用债市场违约事件时有发生，信用风险担忧持续，短端资金成本易上难下，债市情绪谨慎，过剩产业债券发行困难。票据融资下滑主要与 4 月 27 日银监会 126 号文要求加强票据业务监管有关。M2 增速受到去年基数原因影响，回落趋势或至少持续至今年 7 月。M1 与 M2 的剪刀差继续扩大，主因其一楼市火爆致使居民定期存款向企业活期存款转化，其二实体经济疲弱，企业投资意愿不足，资金仍未脱虚向实，未来资产价格仍有上涨风险。

总体而言，随着供给侧改革重回政策重心，各项经济数据均有所回落；而央行仅通过频繁公开市场操作维持市场资金面相对充裕，再宽松的预期减弱。报告期内本组合以配置高评级存单和短融为主，加强信用风险管理。同时在每个资金市场波动时点，特别是月末、季末时间点拉长配置期限，增强组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年上半年，本基金份额净值收益率为 1.1383%，业绩比较基准收益率为 0.6713%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济体走势延续托底+调结构的政策思路，供给侧改革下经济整体下滑趋势未变，预计下半年经济数据将继续走弱，支撑债市收益率向下。6 月末虽然受到 MPA 考核影响，但机构提前做了充足准备，加之央行通过频繁公开市场操作悉心呵护，资金面基本平稳过度。展望下半年，暂未看到债券市场明显利空因素，但货币政策无意继续放水，资金利率难以向下突破，近期长端利率下行较快，收益率曲线平坦化，后续面临回调压力，预计债券收益率呈现震荡走势。组合将继续在保障流动性的前提下做好波段操作，择机拉长久期，把握不同配置品种的交易机会。

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、中证指数有限公司签署服务协议，由其提供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

根据本基金基金合同约定，本基金的收益分配方式为：本基金根据每日基金收益情况，以每百份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，记入投资人收益账户。若收益账户当日累计收益满足结转条件，则为投资人结转相应的基金份额。若当日净收益大于零时，则为投资人收益账户记增收益，满足结转条件的则增加投资人基金份额；若当日净收益等于零时，则保

持投资人基金份额和收益账户收益不变；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日净收益小于零时，不缩减投资人基金份额，记减投资人收益账户收益。基金公司根据以上基金收益分配原则确定投资人的收益份额，并委托登记机构办理相应的基金份额收益结转的变更登记。投资人赎回基金份额时，其对应比例的累计收益将以现金形式支付给投资人；若累计收益为负值，则从投资人赎回基金款中按比例扣除。投资人卖出部分基金份额时，不支付对应的收益；但投资人全部卖出所持基金份额时，全部累计收益将以现金方式与投资人结清。

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，中国银河证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本托管人依法复核景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城交易型货币市场基金2016年半年度报告中财务指标、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，以上内容真实、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：景顺长城交易型货币市场基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	201,243,729.02	1,044,427,089.11
结算备付金		527,000,000.00	899,576,557.12
存出保证金		3,020,801.85	2,338,336.27
交易性金融资产	6.4.7.2	1,038,147,738.31	1,988,592,722.91
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,038,147,738.31	1,988,592,722.91
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	588,212,682.32	1,360,285,320.42
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	6,782,757.05	15,221,637.11
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,364,407,708.55	5,310,441,662.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015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		-	-
应付管理人报酬		349,097.48	653,270.37
应付托管费		104,729.22	195,981.16
应付销售服务费		290,914.62	544,391.99
应付交易费用	6.4.7.7	26,544.09	36,197.47
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		96,066.85	250,486.77
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	332,668.70	109,000.00
负债合计		1,200,020.96	1,789,327.76
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	2,363,207,687.59	5,308,652,335.18
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,363,207,687.59	5,308,652,335.18

负债和所有者权益总计		2,364,407,708.55	5,310,441,662.94
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 100.00 元，基金份额总额 23,632,076.88 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城交易型货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		29,811,463.23
1.利息收入		29,466,900.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,602,633.69
债券利息收入		17,691,155.41
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		4,173,111.00
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		344,563.13
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	344,563.13
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	-
减：二、费用		7,410,826.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,975,644.38
2. 托管费	6.4.10.2.2	892,693.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,479,703.65
4. 交易费用	6.4.7.18	-
5. 利息支出		820,516.79
其中：卖出回购金融资产支出		820,516.79
6. 其他费用	6.4.7.19	242,268.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,400,636.44
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,400,636.44

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城交易型货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	5,308,652,335.18	-	5,308,652,335.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,400,636.44	22,400,636.44
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）	-2,945,444,647.59	-	-2,945,444,647.59
其中：1.基金申购款	3,252,012,856.36	-	3,252,012,856.36
2.基金赎回款	-6,197,457,503.95	-	-6,197,457,503.95
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）	-	-22,400,636.44	-22,400,636.44
五、期末所有者权益（基金净值）	2,363,207,687.59	-	2,363,207,687.59

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

景顺长城交易型货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 867 号《关于准予景顺长城交易型货币市场基金注册的批复》注册,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城交易型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 344,948,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 943 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长

城交易型货币市场基金基金合同》于 2015 年 7 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 344,948,000.00 份基金份额，募集期内未产生利息折份额。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河证券股份有限公司。

根据《景顺长城交易型货币市场基金基金合同》和《景顺长城交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司在基金合同生效日当日，即 2015 年 7 月 16 日为本基金办理份额折算。本基金募集认购金额为 344,948,000.00 元，折算前基金份额总额为 344,948,000.00 份，折算前基金份额净值为 1.0000 元；根据本基金的基金份额折算方法，折算后基金份额总额为 3,449,480.00 份，折算后基金份额净值为 100.00 元。本基金的登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2015 年 7 月 16 日进行了变更登记。

经上海证券交易所上证函[2015]312 号核准，本基金 3,451,484 份基金份额于 2015 年 8 月 3 日在上海证券交易所上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城交易型货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的主要投资范围为现金，通知存款，短期融资券及超级短期融资券，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券，一年以内(含一年)的银行定期存款、协议存款、大额存单，期限在一年以内(含一年)的债券回购，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券，期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、国债、政策性银行金融债，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)企业债券和中期票据，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。本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。

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 2016 年 8 月 25 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<年度报告和半年度报告>》、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》、《景顺长城交易型货币市场基金基金合同》和中国证监会、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间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

本基金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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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 2016 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	1,243,729.02
定期存款	200,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	80,000,000.00
3 个月-1 年	120,000,000.00
其他存款	-
合计：	201,243,729.02

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 2016 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	1,038,147,738.31	1,038,813,000.00	665,261.69	0.0282%
	合计	1,038,147,738.31	1,038,813,000.00	665,261.69	0.0282%

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 2016 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	588,212,682.32	-
合计	588,212,682.32	-

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 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,802.45

应收定期存款利息	288,000.11
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	35,280.00
应收债券利息	6,063,521.21
应收买入返售证券利息	392,929.82
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,223.46
合计	6,782,757.05

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 2016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	26,544.09
合计	26,544.09

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	332,668.70
合计	332,668.70

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	53,086,523.35	5,308,652,335.18
本期申购	32,520,128.56	3,252,012,856.36
本期赎回(以“-”号填列)	-61,974,575.03	-6,197,457,503.95

– 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	23,632,076.88	2,363,207,687.59

注：申购含红利再投份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

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	22,400,636.44	–	22,400,636.44
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	-22,400,636.44	–	-22,400,636.44
本期末	–	–	–

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	425,388.44
定期存款利息收入	6,753,912.08
其他存款利息收入	–
结算备付金利息收入	398,347.93
其他	24,985.24
合计	7,602,633.69

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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,889,167,977.52
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）	2,869,257,050.35

成本总额	
减：应收利息总额	19,566,364.04
买卖债券差价收入	344,563.13

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

本基金本报告期的其他收入项目发生额为零。

6.4.7.18 交易费用

本基金本报告期的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 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	149,178.12
债券托管账户维护费	18,501.52
上市年费	29,835.26
合计	242,268.70

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

无。

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
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	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

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

本基金本期末通过关联方交易单元进行交易。

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 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,975,644.38
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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 0.3% 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 0.3% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	892,693.27

注：支付基金托管人银河证券的托管费按前一日基金资产净值 0.09% 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 0.09% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费
银河证券	631,501.87
景顺长城基金管理有限公司	-
长城证券	393,314.74
合计	1,024,816.61

注：支付基金销售机构的销售服务费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。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 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

本基金本期未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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内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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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
长城证券	6,970,009.00	29.49%	3,028,530.00	5.70%
银河证券	1.00	0.00%	1,680,862.00	3.17%

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

本基金本报告期内未将银行存款保管于关联方。

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

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
22,555,056.36	-	-154,419.92	22,400,636.44	-

6.4.12 期末（2016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，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2015 年 12 月 31 日：同)。

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通过风险管理岗设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交

易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

本基金的基金管理人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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	1,243,729.02	160,000,000.00	40,000,000.00	-	-	-	201,243,729.02
结算备付金	527,000,000.00	-	-	-	-	-	527,000,000.00
存出保证金	3,020,801.85	-	-	-	-	-	3,020,801.85
交易性金融资产	390,032,969.80	568,220,073.73	79,894,694.78	-	-	-	1,038,147,738.31
买入返售金融资产	588,212,682.32	-	-	-	-	-	588,212,682.32
应收利息	-	-	-	-	-	6,782,757.05	6,782,757.05
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,509,510,182.99	728,220,073.73	119,894,694.78	-	-	6,782,757.05	2,364,407,708.55
负债							

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	349,097.48	349,097.48
应付托管费	-	-	-	-	-	104,729.22	104,729.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-	290,914.62	290,914.62
应付交易费用	-	-	-	-	-	26,544.09	26,544.09
应付利润	-	-	-	-	-	96,066.85	96,066.85
其他负债	-	-	-	-	-	332,668.70	332,668.70
负债总计	-	-	-	-	-	1,200,020.96	1,200,020.96
利率敏感度缺口	1,509,510,182.99	728,220,073.73	119,894,694.78	-	-	-	-
上年度末 2015 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	694,427,089.11	350,000,000.00	-	-	-	-	1,044,427,089.11
结算备付金	899,576,557.12	-	-	-	-	-	899,576,557.12
存出保证金	2,338,336.27	-	-	-	-	-	2,338,336.27
交易性金融资产	520,877,478.43	799,628,356.98	668,086,887.50	-	-	-	1,988,592,722.91
买入返售金融资产	1,360,285,320.42	-	-	-	-	-	1,360,285,320.42
应收利息	-	-	-	-	-	15,221,637.11	15,221,637.11
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,477,504,781.35	1,149,628,356.98	668,086,887.50	-	-	15,221,637.11	5,310,441,662.94
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	653,270.37	653,270.37
应付托管费	-	-	-	-	-	195,981.16	195,981.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-	544,391.99	544,391.99
应付交易费用	-	-	-	-	-	36,197.47	36,197.47
应付利润	-	-	-	-	-	250,486.77	250,486.77
其他负债	-	-	-	-	-	109,000.00	109,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,789,327.76	1,789,327.76
利率敏感度缺口	3,477,504,781.35	1,149,628,356.98	668,086,887.50	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。		
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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-391,641.07	-993,156.23
市场利率下降 25 个基点	392,848.69	996,298.33	

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 2016 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 1,038,147,738.31 元，无属于第一或第三层次的余额（于 2015 年 12 月 31 日，第二层次：1,988,592,722.91 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 2016 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（于 2015 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	1,038,147,738.31	43.91
	其中:债券	1,038,147,738.31	43.91
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	588,212,682.32	24.88
	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	728,243,729.02	30.80
4	其他各项资产	9,803,558.90	0.41
5	合计	2,364,407,708.55	100.00

注:银行存款和结算备付金中包含定期存款 200,000,000.00 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	3.43	
	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	34
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	62
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

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	63.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	8.02	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	18.59	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	8.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	1.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.76	-

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	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	119,941,140.66	5.08
	其中：政策性金融债	119,941,140.66	5.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	520,136,077.64	22.01
6	中期票据	-	-
7	同业存单	398,070,520.01	16.84
8	其他	-	-

9	合计	1,038,147,738.31	43.93
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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	111610316	16 兴业 CD316	1,000,000	99,889,153.96	4.23
2	111620053	16 广发银行 CD053	1,000,000	99,586,043.77	4.21
3	111609228	16 浦发 CD228	1,000,000	99,330,596.30	4.20
4	111615130	16 民生 CD130	1,000,000	99,264,725.98	4.20
5	150215	15 国开 15	900,000	90,002,891.83	3.81
6	011699021	16 苏交通 SCP002	700,000	70,144,516.04	2.97
7	011534009	15 东航股 SCP009	500,000	50,033,892.19	2.12
8	011699266	16 建发集 SCP001	500,000	50,015,260.65	2.12
9	071630002	16 财通证券 CP002	500,000	49,999,354.43	2.12
10	011699500	16 苏国信 SCP001	500,000	49,991,794.20	2.12

7.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0988%
报告期内偏离度的最低值	0.0070%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0474%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内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

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

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，基金账面份额净值为 100.00 元。

7.9.2

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。

7.9.3 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	3,020,801.85
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,782,757.05
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,803,558.90

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

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
717	32,957.65	22,370,500.00	94.66%	1,260,138.00	5.33%

注：此为注册登记系统登记的基金份额，与财务报表中 2016 年 6 月 30 日的实收基金数量存在差

异，相差-1,438.88 份。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	长城证券股份有限公司	5,969,975.00	25.26%
2	恒泰证券股份有限公司	2,500,423.00	10.58%
3	恒泰证券股份有限公司	1,500,559.00	6.35%
4	东方汇智资管—光大银行—中国光大银行股份有限公司	1,335,149.00	5.65%
5	长城证券股份有限公司	1,000,034.00	4.23%
6	安徽华通租赁有限公司	910,706.00	3.85%
7	信达证券股份有限公司	760,683.00	3.22%
8	五矿资本控股有限公司	504,476.00	2.13%
9	中融国际信托有限公司-中融-融金添利单一资金信托	500,765.00	2.12%
10	国泰君安证券资管—民生银行—国泰君安悟空量化慧选 1 号集合资产管理计划	370,123.00	1.57%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

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

基金合同生效日（2015 年 7 月 16 日）基金份额总额	3,449,480.00
本报告期期初基金份额总额	53,086,523.35
本报告期基金总申购份额	32,520,128.56
减：本报告期基金总赎回份额	61,974,575.03
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	23,632,076.88

注：本基金根据每日基金收益情况，以每百份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，记入投资人收益账户。收益账户内高于 100.00 元以上的整百元收益将兑付为基金份额

转入投资人的证券账户。注册登记系统中基金份额数不包含留存在收益账户中的因未满足整百元而未兑付为基金份额的收益,所以注册登记系统 2016 年 6 月 30 日的基金份额数与本财务报表中 2016 年 6 月 30 日的实收基金数量存在差异,相差-1,438.88 份

§ 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 2016 年 1 月 22 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,同意黄卫明先生辞去本公司督察长一职。

2、本基金管理人于 2016 年 2 月 4 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,聘任杨皞阳先生担任本公司督察长。

3、本基金管理人于 2016 年 2 月 20 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,聘任毛从容女士担任本公司副总经理。

4、本基金管理人于 2016 年 7 月 4 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,同意赵如冰先生辞去本公司董事长一职,聘任杨光裕先生担任本公司董事长。根据公司章程相关规定,“公司的董事长为公司的法定代表人”。经深圳市市场监督管理局核准,景顺长城基金管理有限公司法定代表人已于 2016 年 7 月 13 日变更为杨光裕先生,本基金管理人已于 2016 年 7 月 15 日发布了公告。

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。

5、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

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	
中国银河证券股份有限公司	3	-	-	-	-	未变更

注：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。

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	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
中国银河证券 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指数熔断后本公司各基金申购赎回、转换业务开放时间调整的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断后本公司各基金申购赎回、转换业务开放时间调整的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
4	景顺长城交易型货币市场基金 2015 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	2016 年 1 月 21 日
5	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	2016 年 1 月 22 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于聘任督察长的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 2 月 4 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 2 月 20 日
8	景顺长城交易型货币市场基金 2016 年第 1 号招募更新说明书摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 3 月 1 日
9	景顺长城交易型货币市场基金 2016 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	2016 年 3 月 1 日
10	景顺长城交易型货币市场基金 2015 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	2016 年 3 月 29 日
11	景顺长城交易型货币市场基金 2015 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	2016 年 3 月 29 日
12	景顺长城交易型货币市场基金 2016 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	2016 年 4 月 20 日

13	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	2016年7月4日
14	景顺长城基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2016年7月15日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内不存在本基金管理人和股东使用自有资金从景顺长城交易型货币市场基金购买金融工具的情况。

§ 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交易型货币市场基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城交易型货币市场基金基金合同》；
- 3、《景顺长城交易型货币市场基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城交易型货币市场基金托管协议》；
- 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
2016年8月27日