

景顺长城景益货币市场基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行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.....	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
3.3 其他指标.....	9
§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合规守信情况的说明.....	11
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.....	12
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.....	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合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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）	15
6.1 资产负债表.....	15
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	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 债券回购融资情况.....	34
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	35
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.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
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.....	36
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	37
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.....	37
7.9 投资组合报告附注.....	37
§8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	38
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	38
§9 开放式基金份额变动.....	39
§10 重大事件揭示.....	39
10.1 基金份额持有人大会决议	39
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	39
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	40
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	44
10.9 其他重大事件	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
§12 备查文件目录.....	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城景益货币市场基金	
基金简称	景顺长城景益货币	
场内简称	无	
基金主代码	000380	
交易代码	000380	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 11 月 26 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,019,799,159.66 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	景顺长城景益货币 A	景顺长城景益货币 B
下属分级基金的交易代码:	000380	000381
报告期末下属分级基金的份额总额	263,019,572.34 份	1,756,779,587.32 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持基金资产安全性和高流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，实现基金的安全稳定回报。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的合理预判，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用定性分析和定量分析方法，综合分析宏观经济指标，包括全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平变动趋势、利率水平和市场预期、通货膨胀率、货币供应量等，对短期利率走势进行综合判断，同时分析央行公开市场操作、主流资金的短期投资倾向、债券供给、货币市场与资本市场资金互动等，并根据动态预期决定和调整组合的平均剩余期限。预期市场利率水平上升，适度缩短投资组合的平均剩余期限，以降低组合下跌风险；预期市场利率水平下降，适度延长投资组合的平均剩余期限，以分享债券价格上升的收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	林葛
	联系电话	0755-82370388	010-66060069

电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	4008888606	95599
传真	0755-22381339	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座
邮政编码	518048	100031
法定代表人	杨光裕	周慕冰

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	景顺长城景益货币 A	景顺长城景益货币 B
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)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,309,394.56	21,431,668.58
本期利润	2,309,394.56	21,431,668.58
本期净值收益率	1.1127%	1.2338%
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	263,019,572.34	1,756,779,587.32
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(2016 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	9.4673%	10.1509%

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、从 2015 年 7 月 15 日起，本基金的收益分配原则由“每日分配、按月支付”调整为“每日分配、按日支付”。

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

景顺长城景益货币 A

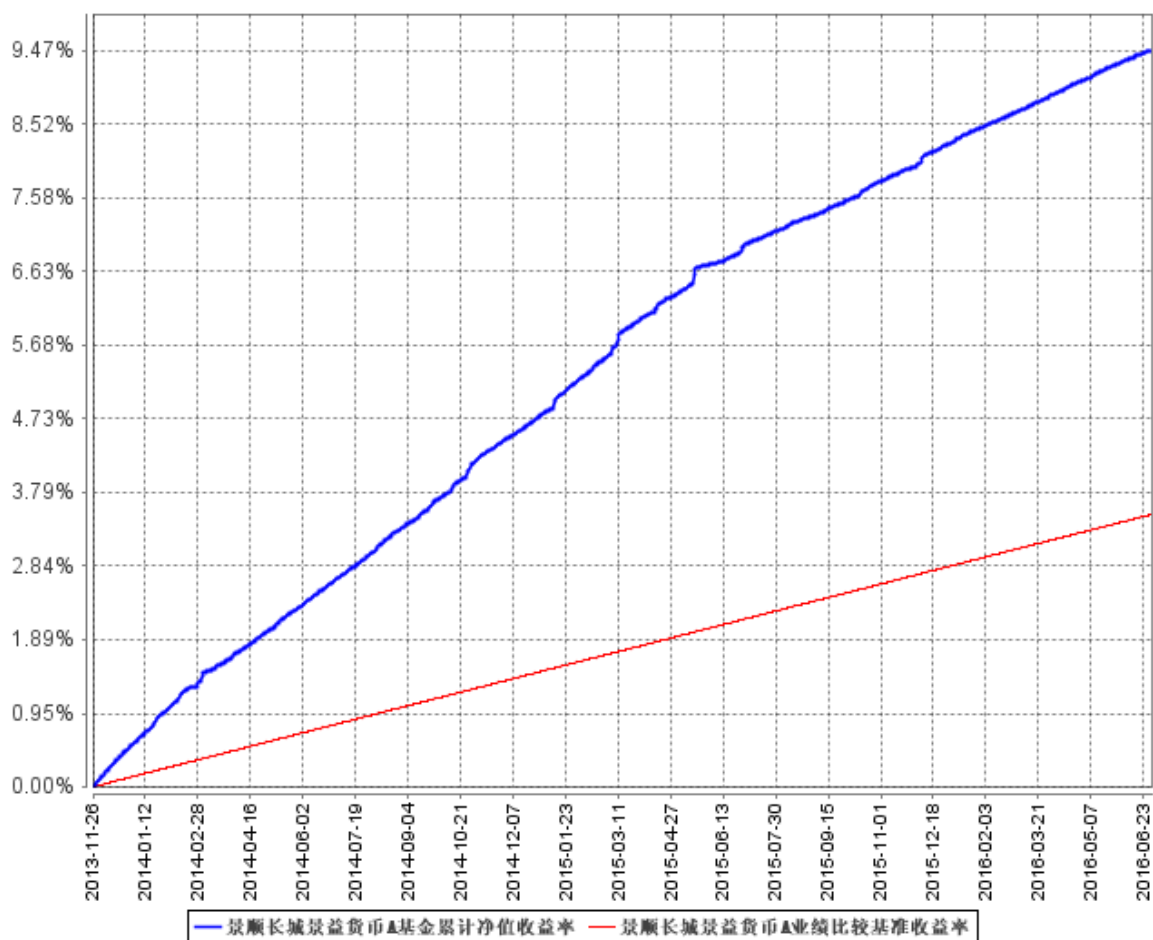
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1582%	0.0028%	0.1107%	0.0000%	0.0475%	0.0028%
过去三个月	0.5366%	0.0026%	0.3357%	0.0000%	0.2009%	0.0026%
过去六个月	1.1127%	0.0025%	0.6713%	0.0000%	0.4414%	0.0025%
过去一年	2.3622%	0.0036%	1.3519%	0.0000%	1.0103%	0.0036%
自基金合同生效起至今	9.4673%	0.0082%	3.5045%	0.0000%	5.9628%	0.0082%

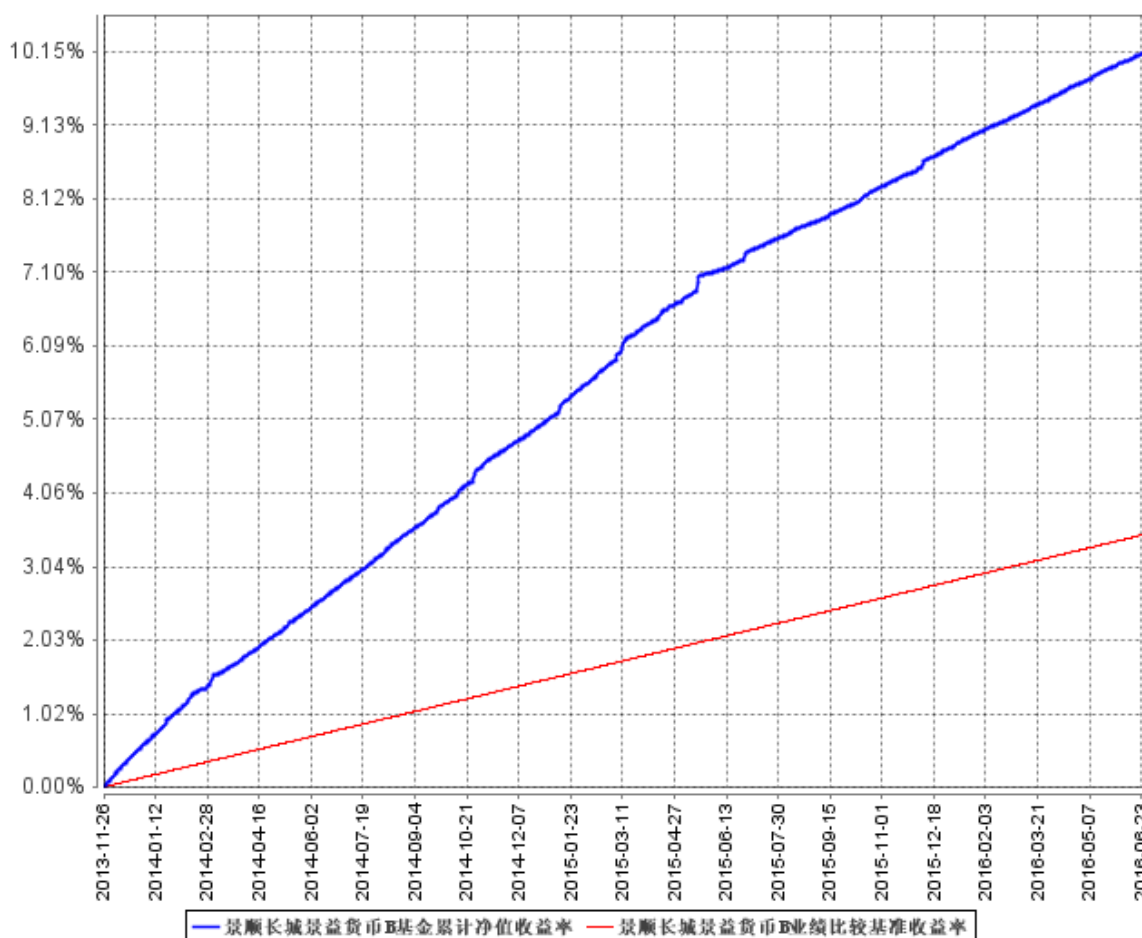
景顺长城景益货币 B

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	0.1776%	0.0028%	0.1107%	0.0000%	0.0669%	0.0028%
过去三个月	0.5963%	0.0026%	0.3357%	0.0000%	0.2606%	0.0026%
过去六个月	1.2338%	0.0025%	0.6713%	0.0000%	0.5625%	0.0025%
过去一年	2.6083%	0.0036%	1.3519%	0.0000%	1.2564%	0.0036%
自基金合同生效起至今	10.1509%	0.0082%	3.5045%	0.0000%	6.6464%	0.0082%

注：本基金的收益分配方式为按日结转份额。

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：本基金的建仓期为自 2013 年 11 月 26 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到投资组合比例的要求。

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	证券	说明
----	----	-----------	----	----

		(助理) 期限		从业 年限	
		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	2014 年 4 月 4 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。

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 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、《景顺长城景益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

上半年经济数据前高后低，1-2 月信贷数据超市场预期，房地产和基建数据回升，随着信贷数据回落，各项经济数据也开始向下，5 月初“权威人士”定调中国经济长期持续 L 型走势，并且不赞同过度投资和过度信贷刺激经济的做法。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。这轮经济回稳来自于房地产政策的放松和财政的支持力度加大，以及银行信贷的支持。应该说权威人士定调比较清晰，经济平稳阶段要推供给侧改革，政策不能大水漫灌，经济增速可能面临回落风险，但前期投入的惯性仍在。

货币政策依然中性偏松，权威人士的论调、央行工作报告中都印证了当前货币政策和市场流动性相比一季度边际上有所趋紧，货币政策基调也从稳健偏宽松逐步趋向实质性稳健。而公开市场利率自去年 10 月底以来一直维持在 2.25% 水平、汇率因素、MPA 考核、对半年末资金面的预期紧张都使得资金利率中枢出现了一定程度的上移。

债券市场收益率波动较大，1 季度在配置盘推动下，信用债收益率继续下行，利率债则在基本面回升推动下收益率有所上行。4 月份受基本面继续好转、通胀压力回升和铁物资事件影响，债券收益率出现明显上行。进入 5 月后，在美国加息预期延后、权威人士判断我国经济运行为 L 型走势、基本面呈现出有利因素等影响下，尤其是英国脱欧公投结果远超市场预期，成为今年以来最大的黑天鹅事件，全球避险情绪急速升温，债券收益率重新回到下行通道。上半年 10 年期国开债、3 年期 AA 中票和 5 年期中票收益率分别上行 6BP、下行 7BP 和下行 6BP 至 3.19%、3.98% 和 4.31%。

年内两次 MPA 考核都造成资金面走紧，但 2 季度实际利率并未出现 1 季度末的大幅波动。本基金根据基金规模变化动态调整短融、回购、存单的配置比例。对流动性要求高的资金部分趁季末 MPA 因素发酵资金面时点进行回购并选取季末利率走高时点择机投资部分协议存款。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年上半年，景益货币 A 净值收益率为 1.1127%，业绩比较基准收益率为 0.6713%；景益货币 B 净值收益率为 1.2338%，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

下半年基建在宽财政带动下仍可能维持高位，房地产投资有一定的惯性，民间投资下滑趋缓，短期经济增长仍有惯性，加上去年下半年的低基数，经济呈现 L 型走势的概率较大。权威人士定调“经济运行 L 型走势”，政策应该不会进行大幅度刺激，增长和通胀略有走弱的概率较大，供

供给侧改革重回政策重心。随着食品价格中鲜菜价格持续回落，猪肉价格涨幅继续放缓，后期食品类价格涨幅预计继续下降，推动下半年 CPI 逐步下行，但需关注石油价格上涨、异常天气因素对 CPI 的冲击。大宗商品价格可能推动 PPI 继续回升，CPI 和 PPI 的剪刀差收窄。

预计货币政策将继续围绕维稳国内资金面和应对人民币贬值，货币政策难言收紧，但大幅宽松的可能性不大。金融去杠杆以及引导资金脱虚向实，预计央行仍会维持短端资金面的平稳。关注央行的降准举措和 7 天逆回购利率的变化。财政政策仍有继续放松的空间，当前政府仍有一定的举债空间。预计依然会继续加大财政政策刺激力度，继续托底经济。

宽松的货币政策转向稳健，在供给侧改革和稳增长的博弈中，实体经济信用扩张放缓，央行在强化利率走廊建设的过程中，仍会通过多种工具，将短端利率维持在其合意水平，防范系统性金融风险。2 季度央行加大力度维稳资金面，一是宣布调整人民币存款准备金考核基数，二是将 MLF 询量、PSL 常态化。美元加息预期、经济回稳、物价回升、人民币汇率压力，降息空间很难看到，降准依赖于外占流出情况。央行主要通过公开市场操作提供流动性。

海外不确定性增加，汇率贬值趋势未改。美国加息预期出现反复，成为干扰市场的风险因素。英国脱欧可能会进一步加大欧盟分裂的风险，市场风险偏好明显下降，避险情绪升温，脱欧后续的演变值得关注。汇率长期取决于中国的经济基本面，长期贬值压力仍存，但近期脱欧事件使得人民币贬值风险进一步释放，考虑在 9 月 G20 峰会前，短期人民币汇率对美元大概率会趋稳。

综上，经济 L 型增长和通胀走弱，货币政策回归中性的定调，基本面对债市影响偏正面，但监管风险的发酵，信用融资的大幅回落，以及美元加息和汇率问题等待靴子落地。基本面和政策面仍可能阶段性推动收益率下行，年初中国国债和美国国债收益率收窄，制约国内无风险利率的下行。今年以来随着避险情绪的上升，全球利率大幅下行并于近期创出历史新低，而中国债市表现相对落后，且上半年人民币贬值了 2.31%，这为国内收益率下行打开空间。但收益率下行空间预计有限，主因是下半年仍面临人民币贬值压力、房价持续上涨后货币政策放松力度继续放缓。相对看好利率债的阶段性机会，不过需把握好波段。信用融资循环出现问题，下半年低评级的信用风险还会暴露，信用利差分化。看好短久期高评级的信用品种。

2016 年债券市场风险点在于人民币汇率风险和个券信用风险。叠加美联储加息预期以及基础货币缺口较大，整个资金面波动仍有风险。货币基金今年将继续关注流动性管理。央行对于基础货币的态度依然是缺多少补多少。密切关注汇率变化及宏观层面因素（MPA 考核等）对资金面的影响，跟踪经济走势、政策和资金面的情况，并及时对组合进行灵活调整，注重保持组合的流动性和适度的组合久期。本基金将强化投资风险控制，在保持基金良好流动性的同时提高静态收益，同时积极灵活把握市场波段操作。平衡配置同业存款和债券投资，保持合理流动性资产配置，细

致管理现金流，以控制利率风险和应对组合规模波动。

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及适用性的情况时，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“每日分配、按日支付”。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—景顺长城基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：景顺长城景益货币市场基金

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	644,511,556.46	1,283,303,503.03
结算备付金		-	503,809.52
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	629,926,821.98	1,439,132,296.66
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		629,926,821.98	1,439,132,296.66
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	657,882,176.82	1,549,755,284.63
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	5,626,302.46	14,789,205.74
应收股利		-	-
应收申购款		84,430,579.98	483,318.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,022,377,437.70	4,287,967,418.40
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		1,617,226.77	1,138,798.14
应付管理人报酬		292,490.87	469,882.98
应付托管费		91,403.42	146,838.41
应付销售服务费		43,970.73	76,628.12
应付交易费用	6.4.7.7	26,529.98	32,328.10
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		111,092.33	245,058.18
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	395,563.94	207,303.34
负债合计		2,578,278.04	2,316,837.27
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	2, 019, 799, 159. 66	4, 285, 650, 581. 13
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2, 019, 799, 159. 66	4, 285, 650, 581. 13
负债和所有者权益总计		2, 022, 377, 437. 70	4, 287, 967, 418. 40

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额 2, 019, 799, 159. 66 份，其中 A 类基金份额净值 1. 0000 元，基金份额总额为 263, 019, 572. 34 份；B 类基金份额净值 1. 0000 元，基金份额总额为 1, 756, 779, 587. 32 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城景益货币市场基金

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	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		28, 857, 008. 58	25, 841, 739. 99
1. 利息收入		27, 812, 536. 24	21, 381, 273. 27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7, 751, 602. 93	5, 784, 657. 39
债券利息收入		15, 362, 572. 68	10, 214, 684. 29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4, 698, 360. 63	5, 381, 931. 59
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1, 044, 472. 34	4, 460, 466. 72
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	1, 044, 472. 34	4, 460, 466. 72
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		5, 115, 945. 44	3, 197, 313. 90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3, 126, 960. 11	1, 872, 310. 14
2. 托管费	6.4.10.2.2	977, 175. 15	567, 366. 73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	347, 158. 91	383, 612. 12
4. 交易费用	6.4.7.18	-	425. 00
5. 利息支出		413, 953. 99	127, 837. 29

其中：卖出回购金融资产支出		413,953.99	127,837.29
6. 其他费用	6.4.7.19	250,697.28	245,762.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,741,063.14	22,644,426.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,741,063.14	22,644,426.09

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城景益货币市场基金

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）	4,285,650,581.13	-	4,285,650,581.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,741,063.14	23,741,063.14
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）	-2,265,851,421.47	-	-2,265,851,421.47
其中：1. 基金申购款	5,367,502,580.23	-	5,367,502,580.23
2. 基金赎回款	-7,633,354,001.70	-	-7,633,354,001.70
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）	-	-23,741,063.14	-23,741,063.14
五、期末所有者权益（基金净值）	2,019,799,159.66	-	2,019,799,159.66
项目	上年度可比期间 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）	2,680,960,935.90	-	2,680,960,935.90
二、本期经营活动产生	-	22,644,426.09	22,644,426.09

最终持有的基金份额等级将由登记机构依据投资者持有的份额余额而定。本基金不同基金份额等级之间不得互相转换，但依据招募说明书约定因认(申)购、赎回、基金转换等交易而发生基金份额自动升级或者降级的除外。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景益货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于现金、通知存款、短期融资券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、协议存款、大额存款、期限在 1 年以内(含 1 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 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城景益货币市场基金基金合同》和中国证监会发布的相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[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	4,511,556.46
定期存款	640,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	640,000,000.00
其他存款	-
合计：	644,511,556.46

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	629,926,821.98	630,630,000.00	703,178.02	0.0348%
	合计	629,926,821.98	630,630,000.00	703,178.02	0.0348%

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	657,882,176.82	-
合计	657,882,176.82	-

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	721.90
应收定期存款利息	407,833.40
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	5,097,714.17
应收买入返售证券利息	120,032.99
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-

合计	5,626,302.46
----	--------------

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	26,529.98
合计	26,529.98

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	2,730.50
预提费用	392,833.44
合计	395,563.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城景益货币 A		
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	439,052,613.52	439,052,613.52
本期申购	517,236,133.42	517,236,133.42
本期赎回(以“-”号填列)	-693,269,174.60	-693,269,174.60
- 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	263,019,572.34	263,019,572.34

金额单位：人民币元

景顺长城景益货币 B

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	3,846,597,967.61	3,846,597,967.61
本期申购	4,850,266,446.81	4,850,266,446.81
本期赎回(以“-”号填列)	-6,940,084,827.10	-6,940,084,827.10
- 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	1,756,779,587.32	1,756,779,587.32

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

景顺长城景益货币 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	2,309,394.56	-	2,309,394.56
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	-2,309,394.56	-	-2,309,394.56
本期末	-	-	-

单位：人民币元

景顺长城景益货币 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	21,431,668.58	-	21,431,668.58
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	-21,431,668.58	-	-21,431,668.58
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	30,501.93
定期存款利息收入	7,716,281.64
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,819.36
其他	-
合计	7,751,602.93

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	2,885,422,521.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,860,803,041.54
减：应收利息总额	23,575,007.49
买卖债券差价收入	1,044,472.34

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

无。

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	18,701.52
银行划款手续费	37,894.84
其他	169.00
合计	250,697.28

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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

注：以下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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	-	-	155,000,000.00	5.04%

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

本基金本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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,126,960.11	1,872,310.14
其中：支付销售机构的客户维护费	132,396.15	196,786.37

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的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。根据本公司于2015年7月14日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于调整景顺长城景益货币市场基金收益分配原则、调低基金管理费率及相应修改基金合同部分条款的公告》，本基金管理费年费率自2015年7月15日起由原先的0.33%变更为0.32%。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 约定年费率 / 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
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	977,175.15	567,366.73

注：支付基金托管人中国农业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		
	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		
	景顺长城景益货币 A	景顺长城景益货币 B	合计
中国农业银行	44,985.41	374.01	45,359.42

景顺长城基金管理有限公司	96,666.91	80,131.31	176,798.22
长城证券	312.60	-	312.60
合计	141,964.92	80,505.32	222,470.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	景顺长城景益货币 A	景顺长城景益货币 B	合计
中国农业银行	90,645.10	1,171.63	91,816.73
景顺长城基金管理有限公司	67,724.36	40,488.13	108,212.49
长城证券	1,680.23	-	1,680.23
合计	160,049.69	41,659.76	201,709.45

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

本基金本期及上年度可比期间均未与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

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末和上年度末均未投资本基金。

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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
中国农业银行	4,511,556.46	30,501.93	5,856,879.14	41,739.89

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

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

景顺长城景益货币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
2,315,248.82	3,630.71	-9,484.97	2,309,394.56	-

景顺长城景益货币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
21,556,098.27	51.19	-124,480.88	21,431,668.58	-

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

截至本报告期末，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。

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 120 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 2016 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 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	544,511,556.46	50,000,000.00	50,000,000.00	-	-	-	644,511,556.46
交易性金融资产	390,203,667.34	139,848,270.34	99,874,884.30	-	-	-	629,926,821.98
买入返售金融资产	657,882,176.82	-	-	-	-	-	657,882,176.82
应收利息	-	-	-	-	-	5,626,302.46	5,626,302.46

应收申购款	584,521.00	-	-	-	-	-83,846,058.98	84,430,579.98
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,593,181,921.62	189,848,270.34	149,874,884.30	-	-	-89,472,361.44	2,022,377,437.70
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,617,226.77	1,617,226.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	292,490.87	292,490.87
应付托管费	-	-	-	-	-	91,403.42	91,403.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-	43,970.73	43,970.73
应付交易费用	-	-	-	-	-	26,529.98	26,529.98
应付利润	-	-	-	-	-	111,092.33	111,092.33
其他负债	-	-	-	-	-	395,563.94	395,563.94
负债总计	-	-	-	-	-	2,578,278.04	2,578,278.04
利率敏感度缺口	1,593,181,921.62	189,848,270.34	149,874,884.30	-	-	-	-
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	923,303,503.03	360,000,000.00	-	-	-	-	1,283,303,503.03
结算备付金	503,809.52	-	-	-	-	-	503,809.52
交易性金融资产	330,344,639.84	520,774,680.82	588,012,976.00	-	-	-	1,439,132,296.66
买入返售金融资产	1,549,755,284.63	-	-	-	-	-	1,549,755,284.63
应收利息	-	-	-	-	-	14,789,205.74	14,789,205.74
应收申购款	20.00	-	-	-	-	483,298.82	483,318.82
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,803,907,257.02	880,774,680.82	588,012,976.00	-	-	-15,272,504.56	4,287,967,418.40
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,138,798.14	1,138,798.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	469,882.98	469,882.98
应付托管费	-	-	-	-	-	146,838.41	146,838.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-	76,628.12	76,628.12
应付交易费用	-	-	-	-	-	32,328.10	32,328.10
应付利润	-	-	-	-	-	245,058.18	245,058.18
其他负债	-	-	-	-	-	207,303.34	207,303.34
负债总计	-	-	-	-	-	2,316,837.27	2,316,837.27
利率敏感度缺口	2,803,907,257.02	880,774,680.82	588,012,976.00	-	-	-	-

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	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	-197, 905. 57	-881, 357. 93
	市场利率下降 25 个基点	198, 585. 68	884, 387. 34

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) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 629, 926, 821. 98 元，无属于第一、三层级的余额(2015 年 12 月 31 日：第二层级 1, 439, 132, 296. 66

元，无第一、三层级)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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级未发生重大变动。

(iv) 第三层级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(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	629,926,821.98	31.15
	其中：债券	629,926,821.98	31.15
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	657,882,176.82	32.53
	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	644,511,556.46	31.87
4	其他各项资产	90,056,882.44	4.45
5	合计	2,022,377,437.70	100.00

注：银行存款和结算备付金其中包含定期存款 640,000,000.00 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	1.98

	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	24
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	76
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	24

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	78.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	6.92	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	2.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	2.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天（含）	4.45	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	95.67	-

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存续期未超过 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	99,882,182.17	4.95
	其中：政策性金融债	99,882,182.17	4.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	480,221,201.53	23.78
6	中期票据	-	-
7	同业存单	49,823,438.28	2.47
8	其他	-	-
9	合计	629,926,821.98	31.19
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	011605001	16 联通 SCP001	900,000	90,037,644.40	4.46
2	011573007	15 鲁高速 SCP007	500,000	50,135,091.96	2.48
3	011699258	16 大唐发电 SCP001	500,000	50,027,509.32	2.48
4	071621003	16 渤海证券 CP003	500,000	50,026,231.79	2.48
5	011699008	16 苏交通 SCP001	500,000	50,007,129.50	2.48
6	071640001	16 东吴证券 CP001	500,000	49,998,561.63	2.48
7	111611171	16 平安 CD171	500,000	49,823,438.28	2.47
8	011699626	16 厦翔业 SCP004	400,000	39,998,759.64	1.98

9	071617002	16 东北证 券 CP002	400,000	39,997,322.74	1.98
10	160204	16 国开 04	400,000	39,943,367.80	1.98

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	0.0858%
报告期内偏离度的最低值	0.0084%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0494%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内，本货币基金未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内，本货币基金未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按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 1.0000 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,626,302.46
4	应收申购款	84,430,579.98

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	90,056,882.44

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
景顺长城景益货币 A	27,634	9,517.97	10,203,095.92	3.88%	252,816,476.42	96.12%
景顺长城景益货币 B	28	62,742,128.12	1,670,655,295.75	95.10%	86,124,291.57	4.90%
合计	27,662	73,017.11	1,680,858,391.67	83.22%	338,940,767.99	16.78%

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	景顺长城景益货币 A	9,148,425.37	3.48%
	景顺长城景益货币 B	-	-
	合计	9,148,425.37	0.45%

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	------	--------------------

本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	景顺长城景益货币 A	10~50
	景顺长城景益货币 B	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开 放式基金	景顺长城景益货币 A	0~10
	景顺长城景益货币 B	-
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城景益货 币 A	景顺长城景益货 币 B
基金合同生效日（2013 年 11 月 26 日）基金 份额总额	954,596,446.24	429,137,040.02
本报告期期初基金份额总额	439,052,613.52	3,846,597,967.61
本报告期基金总申购份额	517,236,133.42	4,850,266,446.81
减：本报告期基金总赎回份额	693,269,174.60	6,940,084,827.10
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	263,019,572.34	1,756,779,587.32

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 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，聘任杨皦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	
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

上海华信证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
川财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
恒泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融 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	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
国金证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	本期新增

国盛证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

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
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有	-	-	-	-	-	-

限公司						
兴业证券股份有 限公司						
中信证券股份有 限公司						
申万宏源证券有 限公司						
长城证券股份有 限公司						
东方证券股份有 限公司						
华福证券有限责 任公司						
广发证券股份有 限公司						
川财证券有限责 任公司						
招商证券股份有 限公司						
平安证券有限责 任公司						
恒泰证券股份有 限公司						
中国国际金融股 份有限公司						
中信建投证券股 份有限公司						
海通证券股份有 限公司						
中国银河证券股 份有限公司						
中国中投证券有 限责任公司						
中泰证券股份有 限公司						
国金证券股份有 限公司						
国盛证券有限责 任公司						
方正证券股份有 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	景顺长城景益货币市场基金2016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	2016年1月9 日
5	景顺长城景益货币市场基金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1月9 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中证金牛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	2016年1月18 日
7	景顺长城景益货币市场基金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
8	景顺长城基金管理有限公司关	中国证券报，上海证券报，	2016年1月22

	于基金行业高级管理人员变更公告	证券时报, 基金管理人网站	日
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增奕丰公司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	2016年1月29日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司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	2016年2月1日
11	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统快速赎回业务新增适用基金的公告	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
12	景顺长城基金管理有限公司关于暂停直销网上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	2016年2月4日
13	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
14	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
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海凯石财富基金销售有限公司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	2016年2月25日
16	景顺长城景益货币市场基金	中国证券报, 上海证券报,	2016年3月29日

	2015 年年度报告	证券时报, 基金管理人网站	日
17	景顺长城景益货币市场基金 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
18	景顺长城景益货币市场基金 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
19	景顺长城基金管理有限公司关于 旗下部分基金新增上海农村 商业银行股份有限公司为销售 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	2016 年 4 月 25 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于 旗下部分基金新增金斧子为 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	2016 年 5 月 11 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于 旗下部分基金新增伯嘉基金 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	2016 年 5 月 16 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于 旗下部分基金新增浙江金观 诚财富管理有限公司为销售机 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	2016 年 5 月 26 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于 旗下部分基金新增北京汇成 基金管理有限公司为销售机构	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016 年 5 月 27 日

	并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告		
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增包商银行作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	2016年6月13 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在新浪仓石开通基金“定期定额投资业务”并参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站	2016年6月22 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通基金“定期定额投资业务”并参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报，上海证券报， 证券时报，基金管理人网站	2016年6月24 日
27	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
28	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景益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景益货币市场基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城景益货币市场基金基金合同》；
- 3、《景顺长城景益货币市场基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城景益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