

景顺长城交易型货币市场基金 2016 年年度 报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银河证券股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 29 日

§1 重要提示

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 2017 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	6,933,697.62 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</p>

	<p>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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年	2015 年 7 月 16 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	33,727,801.02	13,178,376.28
本期利润	33,727,801.02	13,178,376.28

本期净值收益率	2.4099%	0.8834%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末基金资产净值	693,369,761.99	5,308,652,335.18
期末基金份额净值	100.00	100.00

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。

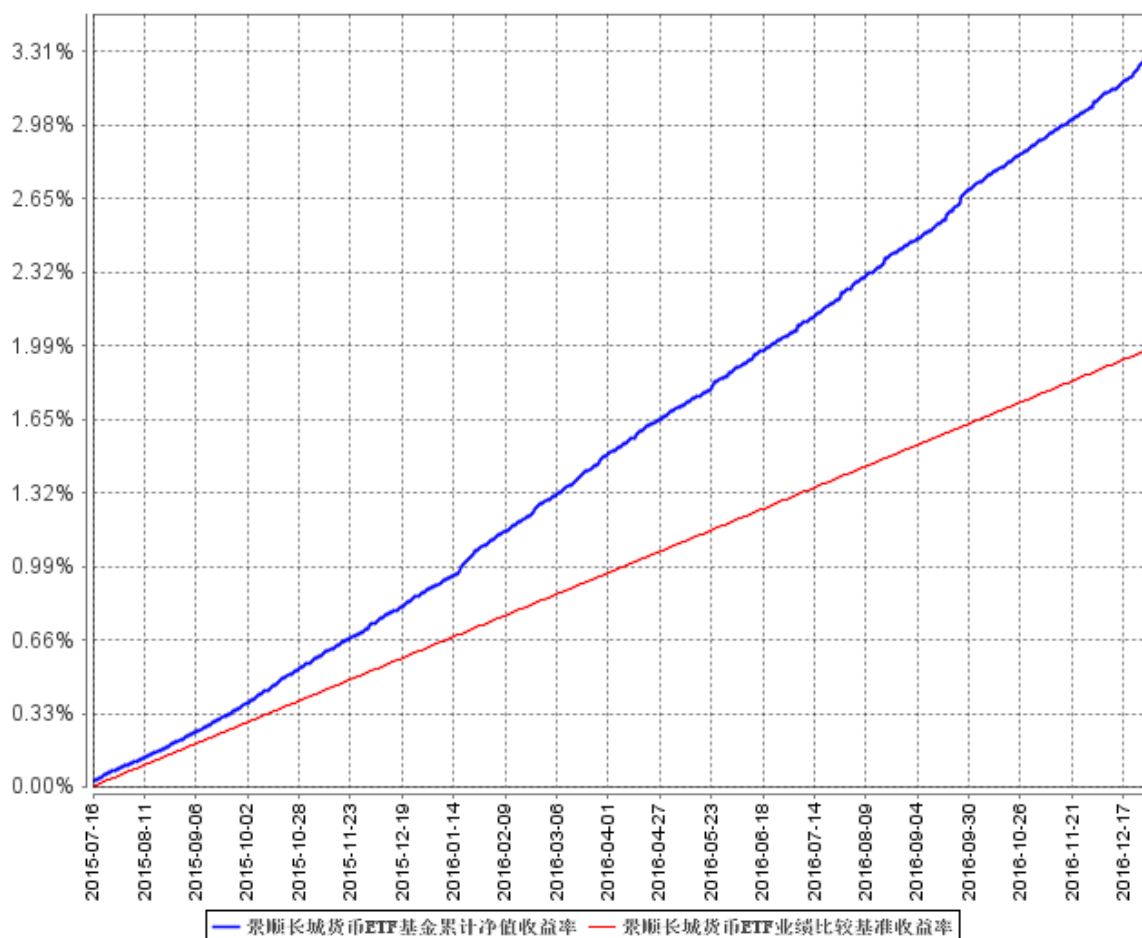
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	0.6100%	0.0021%	0.3393%	0.0000%	0.2707%	0.0021%
过去六个月	1.2573%	0.0035%	0.6787%	0.0000%	0.5786%	0.0035%
过去一年	2.4099%	0.0035%	1.3500%	0.0000%	1.0599%	0.0035%
自基金合同生效起至今	3.3146%	0.0031%	1.9751%	0.0000%	1.3395%	0.0031%

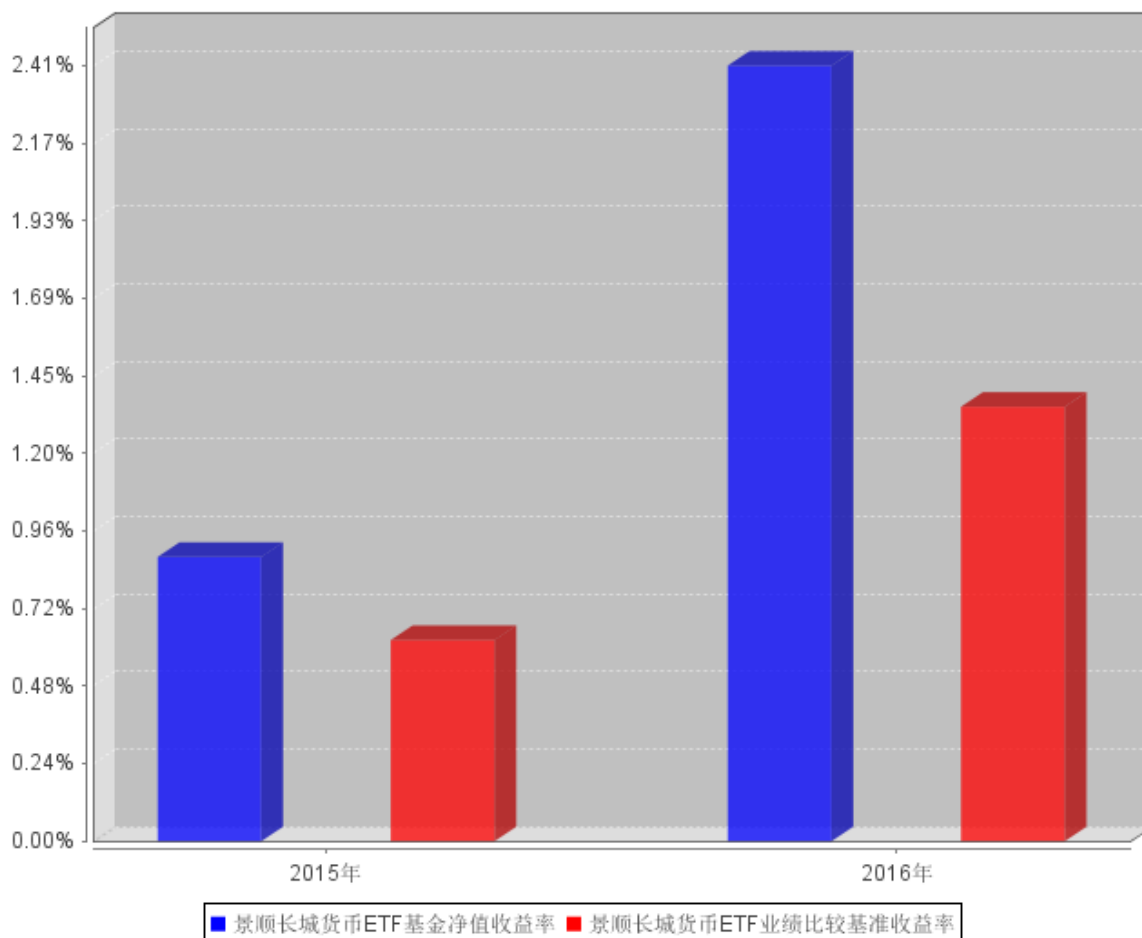
注：本基金的收益分配为每日分配，按日结转份额。

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2015年净值收益率和业绩基准收益率的实际计算期间是从2015年7月16日至2015年12月31日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2016	33,815,698.88	-	-87,897.86	33,727,801.02	
2015	12,927,889.51	-	250,486.77	13,178,376.28	
合计	46,743,588.39	-	162,588.91	46,906,177.30	

§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12月31日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理62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、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景盈金利债券型证券投资基金、景顺长城景颐盛利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金。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		
成念良	本基金的基金经理	2015 年 12 月 11 日	-	7 年	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。
袁媛	本基金的基金经理	2015 年 7 月 16 日	-	9 年	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”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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机

制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理与绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 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投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易现象。

4.3.3 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

回首 2016 年债市，基本面整体偏弱，5 月权威人士定调经济“L”型走势；全年通胀较低但 PPI 在全球大宗商品以及供给侧改革下明显回升，年末出现再通胀预期；强美元下，汇率层面持

续面临贬值压力；货币政策受制于汇率、资产价格等因素态度偏紧，央行主要通过 MLF、逆回购投放流动性，且下半年监管对于去杠杆、防风险等表态明确；同时，8 月后央行陆续重启 14 天、28 天逆回购及 1 年 MLF 等收短放长操作，资金面前松后紧。

对应债券收益率走势。全年呈现波段下行，年末受冲击收益率大幅快速反弹。1 季度在 MLF 利率下调、降准预期以及配置需求主导下，债券收益率逐步下行。随后受大宗商品价格飙涨、信贷大幅投放、稳增长担忧，叠加 1 季度末 MPA 考核带来资金面扰动，债市整体调整。4 月央企铁物资违约，违约风险升温，信用风险向流动性风险蔓延，债市加速去杠杆。5 月权威人士定调中国经济运行 L 型走势，6 月英国脱欧公投的黑天鹅事件点燃全球避险情绪，海外带动国内债券走牛，一直持续到 8 月中旬。国庆期间主要城市陆续出台房地产新政，市场对经济下行的担忧推动债券收益率创出年内低点，10 年国债降至 2.64%，10 年国开降至 3.0%。信用利差也处于历史低位。10 月下旬表外理财纳入 MPA 考核、川普当选美国总统后的经济刺激言论、年末资金偏紧后导致的赎回压力、国海证券代持事件等一系列因素推动债券收益率持续大幅上行。随后，央行投放流动性，市场情绪出现好转，债券收益率有所修复。全年 10 年期国债、10 年期金融债、3 年期 AAA 中票、5 年期 AA 企业债分别上行 19BP、55BP、84BP 和 23BP 至 3.01%、3.68%、3.91%和 4.62%。

报告期内本组合以配置高评级短融和同业存款为主，加强流动性管理的同时，抓住季节性和政策变动的阶段性波动进行合理资产配置，使组合在利率上行阶段能获得较好的配置时机。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年度，本基金净值收益率为 2.4099%，业绩比较基准收益率为 1.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，海外市场的不确定性对国内经济走势的影响将更为显著。2016 年英国脱欧、特朗普胜选等黑天鹅事件频发搅乱金融市场，特朗普胜选后美元大涨、海内外国债大跌、人民币贬值等外溢性，都说明特朗普造成的冲击难以避免。在外交、贸易、投资领域，特朗普上任后如何出招同样难以预期，市场担心减税吸引美国海外企业回流造成美国 GDP 强劲增长，进而强势美元。此外，输入性通胀的加大以及美联储加息也势必会影响到新兴市场国家。

国内宏观经济增长出现企稳态势，全年经济增速有望保持 6.5%。其中房地产限购限贷政策对投资的影响将有所体现，经济增长驱动主要看基建投资是否持续维持高位和制造业投资能否有所反弹。同时，决策层对防范金融风险的强调更为明确。例如，上层特别提到“把降低企业杠杆率作为重中之重”，注重防止金融风险，抑制资产泡沫被强化，“房子是用来住的、不是用来炒

的”等等。预计 2017 年货币政策会比 2016 年显著收紧，而中央经济工作会议首次用“稳健中性”的提法也支持了这一判断。当然，除了资产价格上涨以外，国内通胀压力的增加以及海外美联储鹰派加息的启动等，都是限制货币政策空间的原因。从大类资产配置看，受制于货币政策中性偏紧和中美利差收缩，以及监管升级和去杠杆压力，债券收益率下行空间有限，我们对上半年债券市场比较谨慎。债券投资策略上顺应市场趋势行情，票息弥足珍贵。利率债：经过前期调整基本到位。信用债：信用利差反应并不充分；理财增速放缓，保险资金规范，规范债券代持行为，风险偏好进一步下降，低等级信用债面临信用利差走扩的风险。

组合将继续在保障流动性的前提下做好波段操作，适当降低组合剩余期限，控制各项指标在合理的范围，谨防市场大幅波动对组合的影响。

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 审计报告

本报告期内，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：		
银行存款	322,317,392.77	1,044,427,089.11
结算备付金	-	899,576,557.12
存出保证金	1,123,665.30	2,338,336.27

交易性金融资产	129,847,110.64	1,988,592,722.91
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	129,847,110.64	1,988,592,722.91
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	258,718,808.08	1,360,285,320.42
应收证券清算款	-	-
应收利息	2,019,493.45	15,221,637.11
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	148.50	-
资产总计	714,026,618.74	5,310,441,662.94
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016年12月31日	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	20,000,000.00	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	157,550.59	653,270.37
应付托管费	47,265.18	195,981.16
应付销售服务费	131,292.16	544,391.99
应付交易费用	19,159.91	36,197.47
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	162,588.91	250,486.77
递延所得税负债	-	-
其他负债	139,000.00	109,000.00
负债合计	20,656,856.75	1,789,327.76
所有者权益：		
实收基金	693,369,761.99	5,308,652,335.18
未分配利润	-	-
所有者权益合计	693,369,761.99	5,308,652,335.18
负债和所有者权益总计	714,026,618.74	5,310,441,662.94

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值为 100.00 元，基金份额总额 6,933,697.62 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 7 月 16 日(基金合同生 效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	44,547,790.90	17,720,174.68
1.利息收入	43,959,932.81	17,286,000.52
其中：存款利息收入	11,514,642.93	6,906,307.87
债券利息收入	24,778,174.72	5,618,544.84
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	7,667,115.16	4,761,147.81
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	587,858.09	360,211.53
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	587,858.09	360,211.53
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	73,962.63
减：二、费用	10,819,989.88	4,541,798.40
1. 管理人报酬	4,380,328.34	1,949,213.21
2. 托管费	1,314,098.40	585,615.30
3. 销售服务费	3,650,273.65	1,626,709.04
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	988,089.49	132,860.85
其中：卖出回购金融资产支出	988,089.49	132,860.85
6. 其他费用	487,200.00	247,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	33,727,801.02	13,178,376.28
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	33,727,801.02	13,178,376.28

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	-	33,727,801.02	33,727,801.02
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）	-4,615,282,573.19	-	-4,615,282,573.19
其中：1. 基金申购款	3,948,459,598.88	-	3,948,459,598.88
2. 基金赎回款	-8,563,742,172.07	-	-8,563,742,172.07
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）	-	-33,727,801.02	-33,727,801.02
五、期末所有者权益（基金净值）	693,369,761.99	-	693,369,761.99
项目	上年度可比期间 2015 年 7 月 16 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 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）	344,948,000.00	-	344,948,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,178,376.28	13,178,376.28
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）	4,963,704,335.18	-	4,963,704,335.18
其中：1. 基金申购款	6,821,944,089.51	-	6,821,944,089.51
2. 基金赎回款	-1,858,239,754.33	-	-1,858,239,754.33

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）	-	-13,178,376.28	-13,178,376.28
五、期末所有者权益（基金净值）	5,308,652,335.18	-	5,308,652,335.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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。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 2017 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》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，对国债、地方政府债以及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。

7.4.7 关联方关系

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、基金销售机构
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
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 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12月31日	2015年7月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,380,328.34	1,949,213.21
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。

7.4.8.2.2 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12月31日	2015年7月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,314,098.40	585,615.30

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。

7.4.8.2.3 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12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
银河证券	843,979.86
景顺长城基金管理有限公司	-
长城证券	484,490.98
合计	1,328,470.84
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	2015年7月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
银河证券	553,684.74
景顺长城基金管理有限公司	-

长城证券	467,403.27
合计	1,021,088.01

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 × 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自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及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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12月31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	-	-	3,028,530.00	5.70%
银河证券	-	-	1,680,862.00	3.17%

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金本报告期及上年度可比期间未将银行存款保管于关联方。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须说明的其他关联交易事项。

7.4.9 (2016年12月31日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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 12 月 31 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 129,847,110.64 元，无属于第一或第三层次的余额（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 12 月 31 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	129,847,110.64	18.19
	其中：债券	129,847,110.64	18.19
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	258,718,808.08	36.23
	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	322,317,392.77	45.14
4	其他各项资产	3,143,307.25	0.44
5	合计	714,026,618.74	100.00

注：银行存款和结算备付金其中包含货币基金定期存款 290,000,000.00 元。

8.2 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	2.44	
	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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	40
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	74

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26
-------------------	----

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。

8.3.2 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	68.10	2.88
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	23.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	11.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	102.69	2.88

8.4 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。

8.5 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	39,874,957.46	5.75
	其中：政策性金融债	39,874,957.46	5.75
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	89,972,153.18	12.98
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-

8	其他	-	-
9	合计	129,847,110.64	18.73
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 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	011698351	16 厦翔业 SCP011	400,000	40,003,934.52	5.77
2	011609005	16 国电集 SCP005	300,000	29,993,876.28	4.33
3	011698391	16 华电 SCP015	200,000	19,974,342.38	2.88
4	160211	16 国开 11	200,000	19,880,753.54	2.87
5	160401	16 农发 01	100,000	9,999,734.34	1.44
6	160209	16 国开 09	100,000	9,994,469.58	1.44

8.7 “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	-0.0955%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0473%

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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

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。

8.9.2

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。

8.9.3 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	1,123,665.30
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,019,493.45
4	应收申购款	-
5	其他应收款	148.50
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,143,307.25

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
466	14,877.80	6,332,278.00	91.33%	600,775.00	8.67%

注：此为注册登记系统登记的基金份额，与财务报表中 2016 年 12 月 31 日的实收基金数量存在差异，相差-644.62 份。

9.2 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	安徽华通租赁有限公司	921,977.00	13.30%
2	深圳悟空投资管理有限公司—悟空对冲量化三期基金	833,246.00	12.02%
3	深圳悟空投资管理有限公司—悟空绿城对冲量化二期证券投资基金	549,635.00	7.93%

4	海通证券股份有限公司	441,569.00	6.37%
5	信达证券股份有限公司	401,957.00	5.80%
6	深圳悟空投资管理有限公司— 悟空对冲量化四期证券投资基金	377,683.00	5.45%
7	华鑫国际信托有限公司—华鑫 信托·源乐晟策略创新 1 期证 券投资集合资金信托计划	300,068.00	4.33%
8	深圳市金斧子资本管理有限公 司—源乐晟全球精选基金	300,035.00	4.33%
9	中信信托有限责任公司—建苏 709	212,662.00	3.07%
10	深圳悟空投资管理有限公司— 悟空利得对冲量化一期证券投 资基金	196,370.00	2.83%

9.3 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。

9.4 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。

§10 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	344,948,000.00
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	39,484,595.99
减：本报告期基金总赎回份额	85,637,421.72
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	6,933,697.62

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 12 月 31 日的基金份额数与本财务报表中 2016 年 12 月 31 日的实收基金数量存在差异，差异为-644.62 份。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

基金管理人重大人事变动：

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。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 2 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 90,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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。

11.7.2 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
中国银河证券股份有限公司	-	-	40,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 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。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

景顺长城基金管理有限公司
2017年3月29日