

景顺长城景丰货币市场基金 2019 年半年度 报告摘要

2019 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 21 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 2019 年 06 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城景丰货币	
场内简称	无	
基金主代码	000701	
交易代码	000701	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 9 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	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	12,952,748,909.33 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城景丰货币 A	景顺长城景丰货币 B
下属分级基金的交易代码	000701	000707
报告期末下属分级基金的份额总额	244,990,443.87 份	12,707,758,465.46 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，通过运用各种投资工具及投资策略，力争获取高于业绩比较基准的投资回报。
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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95561
传真	0755-22381339	021-62159217

2.4 信息披露方式

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

§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(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	景顺长城景丰货币 A	景顺长城景丰货币 B
本期已实现收益	3,190,419.12	179,809,538.63
本期利润	3,190,419.12	179,809,538.63
本期净值收益率	1.2848%	1.4054%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	期末基金资产净值	244,990,443.87
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(2019年6月30日)	
	累计净值收益率	16.6303%

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、本货币基金的收益分配方式为按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城景丰货币 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	0.2078%	0.0007%	0.1110%	0.0000%	0.0968%	0.0007%
过去三个月	0.6200%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.2834%	0.0007%
过去六个月	1.2848%	0.0009%	0.6695%	0.0000%	0.6153%	0.0009%
过去一年	2.6614%	0.0009%	1.3500%	0.0000%	1.3114%	0.0009%
过去三年	9.7444%	0.0021%	4.0481%	0.0000%	5.6963%	0.0021%
自基金合同生 效起至今	16.6303%	0.0032%	6.4652%	0.0000%	10.1651%	0.0032%

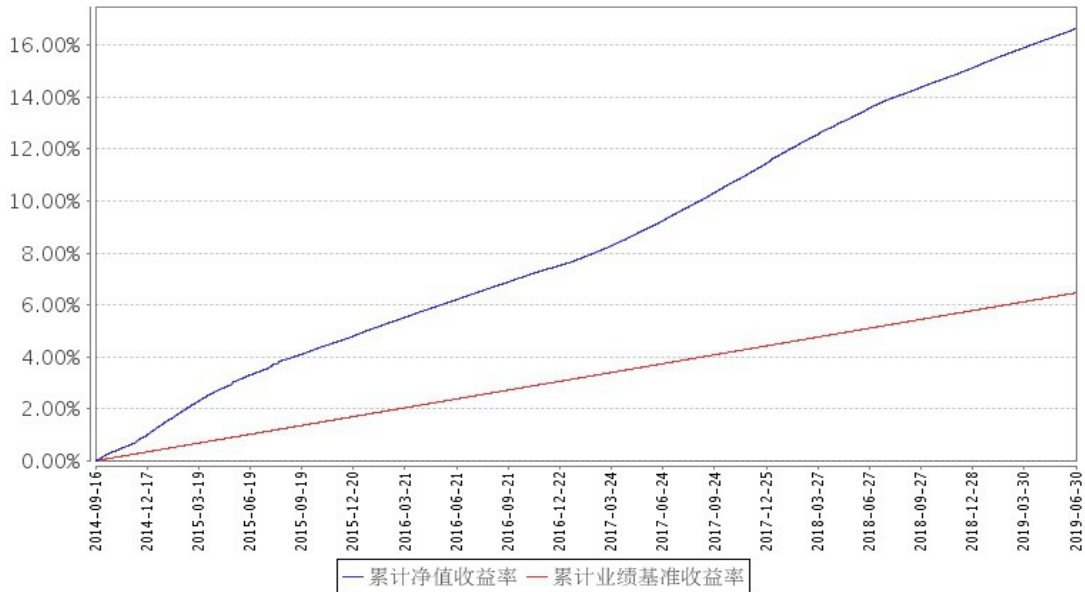
景顺长城景丰货币 B

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	0.2276%	0.0007%	0.1110%	0.0000%	0.1166%	0.0007%
过去三个月	0.6800%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.3434%	0.0007%
过去六个月	1.4054%	0.0009%	0.6695%	0.0000%	0.7359%	0.0009%
过去一年	2.9078%	0.0009%	1.3500%	0.0000%	1.5578%	0.0009%
过去三年	10.5376%	0.0021%	4.0481%	0.0000%	6.4895%	0.0021%
自基金合同生 效起至今	17.9757%	0.0032%	6.4652%	0.0000%	11.5105%	0.0032%

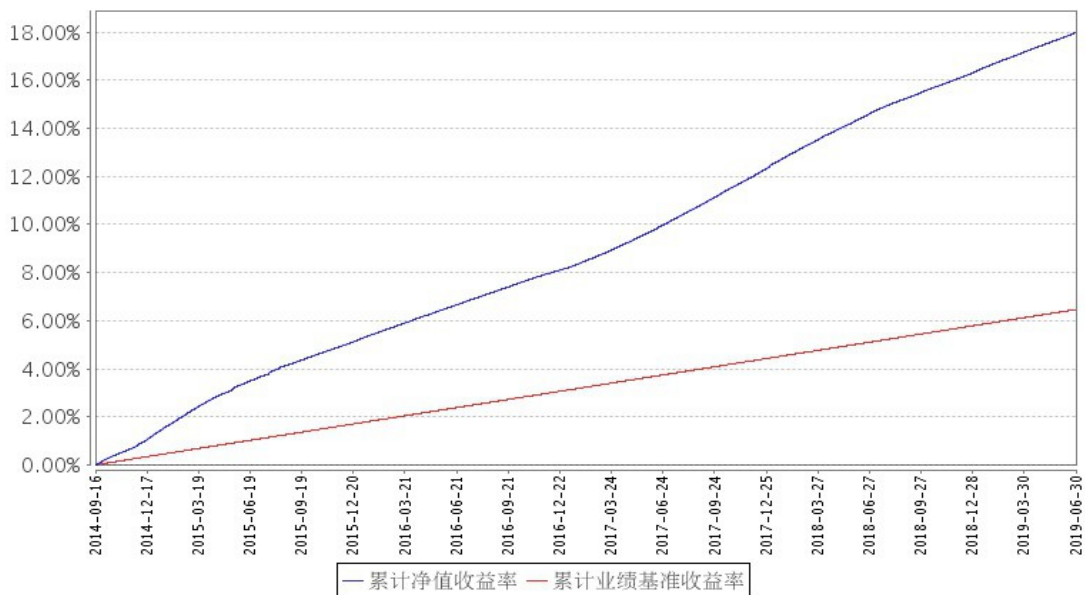
注：本基金的收益分配为每日分配，按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

景顺长城景丰货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城景丰货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的建仓期为 2014 年 9 月 16 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合符合基金合同的有关约定。

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。

截至2019年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理75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、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TMT150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、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化小盘股票型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金、景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景泰鑫利纯债债券型证券投资基金、景顺长城智能生活混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金、景顺长城集英成长两年定期开放混合型证券投资基金、景顺长城量化港股通股票型证券投资基金、景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金。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		
陈威霖	本基金的基金经理	2016 年 4 月 20 日	-	8	管理学硕士。曾担任平安利顺货币经纪公司债券市场部债券经纪人。2013 年 6 月加入本公司，历任交易管理部交易员、固定收益部信用研究员，自 2016 年 4 月起担任固定收益部基金经理。
米良	本基金的基金经理	2018 年 12 月 12 日	-	5	经济学硕士。曾担任汇丰银行（中国）有限公司零售银行部管理培训生、零售银行部高级客户经理，汇丰银行深圳分行贸易融资部产品经理，招商银

					行资产负债部资产管理岗，2018 年 9 月加入我公司，自 2018 年 11 月起担任固定收益部基金经理。
成念良	本基金的基金经理	2015 年 12 月 11 日	2019 年 1 月 24 日	10	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”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、《景顺长城景丰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

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 57 次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，公司旗下指数基金因指数成份股调整，

以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间虽然存在临近交易日同向交易行为，但结合交易时机及市场交易价格波动分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。投资组合间虽然存在相邻反向异常交易，经分析为投资组合开放期内投资者连续赎回导致的被动行为，非不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 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

上半年央行货币政策总体保持稳健，根据内外部环境变化相机微调，以最大程度发挥逆周期调节的作用。资金面表现上，货币供给松紧适度，阶段性特征明显，资金面波动有所加大，半年末短端价格大幅走低至历史低点。

具体来看，央行于年初降准两次、同时使用定向中期借贷便利 TMLF 叠加普惠金融等结构性数量工具向市场投放了中长期流动性，维稳春节前资金面的同时引导金融机构扩大信贷投放，降低贷款成本。春节后由于市场风险偏好抬升，资金由货基、债基、理财流出向权益市场，日间资金面波动次数增多，但波动时间较短。2 季度，央行货币政策例会重提“闸门”二字，政治局会议的定调继续结构性去杠杆，货币政策边际收敛，资金利率中枢水平较前期有所抬升。5 月初，为应对中美贸易摩擦升级，央行超预期盘中宣布针对部分中小银行实施定向降准，同时在 1 季度暂停 MLF 操作后再次超量续作 MLF。5 月底受包商银行事件影响，银行间流动性传导链条收缩，市场流动性出现分层现象，央行通过 MLF 增量续作、为中小银行存单提供增信支持、增加再贴现及常备借贷便利额度、提高头部券商发债余额上限等措施疏通市场流动性，货币政策态度进一步中性温和，通过公开市场操作集中投放流动性，确保年中时点平稳度过。

价格方面，上半年政策利率没有调整，货币市场利率中枢先上后下，期限利差大幅走阔。DR001 由年初缓慢上行，并在 4 月中旬达到 2.98% 的阶段高点，而后受国内外事件影响，资金面持续宽松，隔夜价格屡创新低，并于 6 月底达到了 0.95% 的历史低点。存单价格方面，3M 存单从年初 3% 位置一路下行至 2.75% 后转为上行，在 4 月末达到阶段高点 3% 后于 6 月份持续走低，并于半年末达到年内低点 2.5% 水平。一年期国股存单虽有下行，但始终维持在 3% 以上，货币市场利率曲线仍较为陡峭。

报告期内组合严格遵循公募流动性新规中对于货币基金操作的规定，鉴于上半年央行货币政策相机抉择，松紧转换较为频繁，组合也相应的灵活调整杠杆比率。因资产收益中枢下移，且对时点上赎回压力保持谨慎态度，组合维持了中短水平久期。受包商事件影响，市场风险偏好均有所

下降，组合也进一步提高了风控要求，在配置上仍以同业存款和高评级同业存单为主，并适当增加了逆回购的比例，在保持较好流动性的同时获得稳定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019 上半年，景丰货币 A 净值收益率为 1.2848%，业绩比较基准收益率为 0.6695%；景丰货币 B 净值收益率为 1.4054%，业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济回落，美联储释放降息信号，澳大利亚印度等国相继降息，全球新一轮宽松开启。国内方面，地产 5 月开始出现走弱，制造业和基建投资依然较弱，消费受基数影响回升，但整体难有起色。而包商银行事件将在中长期影响小银行负债端，预计小银行的信用扩张能力会大幅收缩，低等级企业的融资成本将明显上升，对市场有紧信用的负面效应。

政策面上，下半年货币政策仍有宽松空间，继续运用降准或其他利率工具进一步降低中小企业和民营企业的融资成本。外围降息后预计央行有一定概率降低 MLF 利率或公开市场利率。而在利率并轨上，可能逐步推进 LPR 利率的市场接受度，为将来取消基准利率做铺垫。财政政策上，受财政提前发力制约，下半年财政支出预计比上半年放缓，但在外部风险及内部下行压力升级下，财政政策大概率保持积极，基建仍是重要抓手。但预计政策主要是对经济起到托底作用，整体经济延续弱势下行。

资金面上，预计将较前期有所收敛，资金价格中枢提高，货币市场期限利差预期收窄。半年末市场流动性宽松，是央行为避免中小行、非银在信用收缩、流动性分层的背景下叠加季末时点而出现流动性风险，是一种危机处理模式。随着新的流动性传导机制（大行—中小银行/大型券商—非银）的疏通，央行货币政策预计也将逐步走出危机处理模式，回归常态化，资金面上也将有所收敛。展望 3 季度，货币政策预计维持合理充裕，保持定力，并兼顾灵活适度。前期大幅走低的短端利率预计将有所提高，从而压缩与长端的期限利差。市场普遍预期美联储年内降息，而且大概率 3 季度会降息一次，我国央行是否跟随调低政策利率值得关注。

组合将密切关注宏观基本面数据、贸易摩擦进展以及央行货币政策操作，细致管理现金流。配置上仍将以同业存款为主，但在同业打破刚兑后，对信用风险的把控上将更为谨慎，规避黑天鹅事件对组合的冲击。在资产价格从目前低点回归中性的过程中，调整逆回购和同业存单的配置比例，逐步拉长久期，增加组合收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等

方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

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送给基金托管人，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，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委员会的运作。研究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、行业发展及个券状况等各方面因素，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委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究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委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。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。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会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、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

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、按月支付”。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在

本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，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的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本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、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：景顺长城景丰货币市场基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	4,880,548,366.33	3,303,725,673.83
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	3,905,769,163.96	4,447,373,717.42
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,905,769,163.96	4,447,373,717.42
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	4,428,825,643.23	935,475,843.21
应收证券清算款	-	-
应收利息	87,286,932.85	41,800,798.19
应收股利	-	-
应收申购款	83,588,466.88	146,249,332.10
递延所得税资产	-	-
其他资产	561.00	-
资产总计	13,386,019,134.25	8,874,625,364.75
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2019 年 6 月 30 日	2018 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	416,599,591.70	645,798,511.30
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	93,694.42	99.88
应付管理人报酬	1,819,893.04	1,108,840.50
应付托管费	485,304.80	295,690.82
应付销售服务费	168,238.37	124,838.26
应付交易费用	188,812.03	122,102.20
应交税费	64,470.53	16,996.80
应付利息	48,345.83	334,531.24
应付利润	13,657,416.03	8,165,438.41
递延所得税负债	-	-
其他负债	144,458.17	449,000.15
负债合计	433,270,224.92	656,416,049.56
所有者权益：		
实收基金	12,952,748,909.33	8,218,209,315.19
未分配利润	-	-
所有者权益合计	12,952,748,909.33	8,218,209,315.19
负债和所有者权益总计	13,386,019,134.25	8,874,625,364.75

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 12,952,748,909.33 份，其中景顺长城景丰货币 A 基金份额总额为 244,990,443.87 份，基金份额净值 1.0000 元；景顺长城景丰货币 B 基金份额总额为 12,707,758,465.46 份，基金份额净值 1.0000 元。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城景丰货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	201,889,460.18	282,579,246.71
1. 利息收入	198,519,532.81	281,286,461.50
其中：存款利息收入	74,458,472.86	126,767,599.89
债券利息收入	72,087,991.71	67,568,320.42
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	51,973,068.24	86,950,541.19
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	3,369,927.37	1,292,785.21
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,369,927.37	1,292,785.21

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）	-	-
减：二、费用	18,889,502.43	15,374,141.93
1. 管理人报酬	9,846,712.05	10,124,192.06
2. 托管费	2,625,789.78	2,699,784.49
3. 销售服务费	952,847.80	1,316,238.96
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	5,269,572.93	960,358.20
其中：卖出回购金融资产支出	5,269,572.93	960,358.20
6. 税金及附加	39,662.25	28,658.95
7. 其他费用	154,917.62	244,909.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	182,999,957.75	267,205,104.78
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	182,999,957.75	267,205,104.78

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城景丰货币市场基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	8,218,209,315.19	-	8,218,209,315.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	182,999,957.75	182,999,957.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	4,734,539,594.14	-	4,734,539,594.14

(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	32,413,325,166.99	-	32,413,325,166.99
2. 基金赎回款	-27,678,785,572.85	-	-27,678,785,572.85
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)	-	-182,999,957.75	-182,999,957.75
五、期末所有者权益(基金净值)	12,952,748,909.33	-	12,952,748,909.33
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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)	15,143,879,765.50	-	15,143,879,765.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	267,205,104.78	267,205,104.78
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)	-10,129,988,565.11	-	-10,129,988,565.11
其中: 1. 基金申购款	42,998,172,218.84	-	42,998,172,218.84
2. 基金赎回款	-53,128,160,783.95	-	-53,128,160,783.95
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)	-	-267,205,104.78	-267,205,104.78
五、期末所有者权益(基金净值)	5,013,891,200.39	-	5,013,891,200.39

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：

康乐

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

顺长城景丰货币市场基金(以下简称“景顺长城景丰货币基金”)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[2014]第 594 号《关于核准景顺长城景丰货币市场基金募集的批复》核准,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《景顺长城景丰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 306,246,980.34 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(2014)第 537 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城景丰货币市场基金基金合同》于 2014 年 9 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 306,260,627.12 份基金份额,其中认购资金利息折合 13,646.78 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《景顺长城景丰货币市场基金基金合同》和《景顺长城景丰货币市场基金招募说明书》,本基金根据基金份额持有人持有本基金份额余额的数量,划分不同级别的基金份额,并对投资者持有的不同级别的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用。本基金基金份额分为 A 级和 B 级,投资者单个基金账户所持有份额余额高于 500 万份(含)时,账户内所有基金份额归为 B 级,否则归为 A 级。基金成立后,在基金存续期内的任何一个开放日,注册登记机构根据上述分级原则对投资者单个基金账户所持有份额的份额级别进行判断和处理。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景丰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、期限在一年以内(含一年)的银行存款、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、期限在一年以内(含一年)的同业存单、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的短期融资券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的中期票据、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为:同期 7 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 2019 年 8 月 21 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》、《景顺长城景丰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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与会计估计和最近一期年度报告一致。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务, 以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

**6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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、登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应付关联方佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,846,712.05	10,124,192.06
其中：支付销售机构的客户维护费	444,021.09	514,994.52

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 0.15% 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 \times 0.15% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,625,789.78	2,699,784.49

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.04% 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 \times 0.04% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城景丰货币 A	景顺长城景丰货币 B	合计
景顺长城基金管理有限公司	90,312.53	582,528.44	672,840.97
兴业银行	3,891.75	-	3,891.75
合计	94,204.28	582,528.44	676,732.72
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城景丰货币 A	景顺长城景丰货币 B	合计
景顺长城基金管理有限公司	74,981.96	584,833.55	659,815.51
兴业银行	5,633.80	21.92	5,655.72
合计	80,615.76	584,855.47	665,471.23

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

本期 2019年1月1日至2019年6月30日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	329,276,753.24	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	100,188,690.41	-	-	-	-	-

6.4.8.4 各 关 联 方 投 资 本 基 金 的 情 况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
	景顺长城景丰货币 A	景顺长城景丰货币 B
基金合同生效日（2014 年 9 月 16 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	326,479,716.10
期间申购/买入总份额	-	452,223,716.22
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	439,000,000.00
期末持有的基金份额	-	339,703,432.32
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	2.67%

项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
	景顺长城景丰货币 A	景顺长城景丰货币 B
基金合同生效日（2014 年 9 月 16 日）持有的基金份额		
期初持有的基金份额		225,700,782.36
期间申购/买入总份额		500,733,158.04
期间因拆分变动份额		
减：期间赎回/卖出总份额		428,000,000.00
期末持有的基金份额		298,433,940.40
期末持有的基金份额 占基金总份额比例		6.29%

注：1. 固有资金投资持有本基金 B 类基金份额，期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额；报告期末持有的基金份额占比为占 B 类基金总份额的比例。

2. 基金管理人景顺长城基金管理有限公司在本年度申购/赎回本基金的交易委托景顺长城基金管理有限公司直销中心办理，根据《景顺长城景丰货币市场基金招募说明书》的相关规定，本基金不收取申购费用与赎回费用。

6.4.8.4.2 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

景顺长城景丰货币 B

关联方名称	本期末		上年度末	
	2019 年 6 月 30 日		2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
景顺长城资产管理 (深圳) 有限公司	120,647,354.21	0.95	25,540,296.49	0.32

注：景顺长城资产管理(深圳)有限公司上年度报告期末持有本基金份额为 B 类基金份额，持有的基金份额占比为占 B 类基金总份额的 0.32%，本报告期末持有本基金份额为 B 类基金份额，持有的基金份额占比为占 B 类基金总份额的 0.95%。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
兴业银行	2,548,366.33	85,221.65	4,076,879.21	106,489.02

注：本基金的活期银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.8.6 本
基
金
在
承
销
期
内
参
与
关
联
方
承
销
证
券
的
情
况**

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2019 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.9.2 期
末
持
有
的
暂
时
停
牌
等
流
通
受
限
股
票**

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 416,599,591.70 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
120231	12 国开 31	2019 年 7 月 1 日	100.03	500,000	50,014,888.95
120412	12 农发 12	2019 年 7 月 1 日	100.04	1,500,000	150,061,406.44
160420	16 农发 20	2019 年 7 月 1 日	100.01	900,000	90,013,005.95
180209	18 国开 09	2019 年 7 月 1 日	100.02	1,400,000	140,031,148.26
合计				4,300,000	430,120,449.60

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 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 2019 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 3,905,769,163.96 元，无属于第一或第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第二层次 4,447,373,717.42 元，无第一或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 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(2018 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) 其他

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	3,905,769,163.96	29.18
	其中：债券	3,905,769,163.96	29.18
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,428,825,643.23	33.09
	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	4,880,548,366.33	36.46
4	其他各项资产	170,875,960.73	1.28
5	合计	13,386,019,134.25	100.00

注：银行存款和结算备付金合计中包含定期存款 4,878,000,000.00 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	4.03	
	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	416,599,591.70	3.22
	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基金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

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 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	50
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	86
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	46

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	56.47	3.22
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	20.59	-
	其中：剩余存续期超过 397 天	-	-

	的浮动利率债		
3	60 天（含）—90 天	13.39	-
	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）	11.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	102.03	3.22

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	318,967,655.88	2.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	620,446,685.49	4.79
	其中：政策性金融债	620,446,685.49	4.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,370,584,457.97	10.58
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,595,770,364.62	12.32
8	其他	-	-
9	合计	3,905,769,163.96	30.15
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名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	111808302	18 中信银行 CD302	2,000,000	198,975,172.84	1.54
2	120412	12 农发 12	1,500,000	150,061,406.44	1.16
3	011900034	19 苏交通 SCP001	1,500,000	150,037,649.22	1.16
4	011901075	19 南电 SCP016	1,500,000	149,898,565.04	1.16
5	180209	18 国开 09	1,400,000	140,031,148.26	1.08

6	199922	19 贴现国债 22	1,400,000	139,441,416.90	1.08
7	041800259	18 汇金 CP003	1,300,000	130,294,932.36	1.01
8	011801969	18 光大集团 SCP002	1,300,000	130,095,727.55	1.00
9	011900245	19 南航股 SCP001	1,000,000	100,112,066.28	0.77
10	071900051	19 中信建投 CP003	1,000,000	100,019,125.34	0.77

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	0.0763%
报告期内偏离度的最低值	0.0127%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0407%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内，本货币基金未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内，本货币基金未发生正偏离度的绝对值达到 0.50%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

1、中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”，股票代码：601998）于 2018 年 11 月 19 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监银罚决字[2018]14 号）。其因理财资金违规缴纳土地款、自有资金融资违规缴纳土地款、为非保本理财产品提供保本承诺、本行信贷资金为理财产品提供融资、收益权转让业务违规提供信用担保、项目投资审核严重缺位等事项，违反了《中国人民银行中国银行业监督管理委员会关于加强商业性房地产信贷管理的通知》、《中国人民银行中国银行业监督管理委员会关于金融促进节约集约用地的通知》、《中华人民共和国银行业监督管理法》、《商业银行内部控制指引》等相关规定，被处以罚款 2280 万元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对中信银行同业存单进行了投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受

到公开谴责、处罚的情况。

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	87,286,932.85
4	应收申购款	83,588,466.88
5	其他应收款	561.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	170,875,960.73

§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 (%)
景顺长城景丰货币 A	43,627	5,615.57	79,516,989.90	32.46	165,473,453.97	67.54
景顺长城景丰货币 B	81	156,885,906.98	12,702,057,087.17	99.96	5,701,378.29	0.04
合计	43,708	296,347.33	12,781,574,077.07	98.68	171,174,832.26	1.32

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 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	银行类机构	930,177,666.72	7.37
2	银行类机构	804,000,782.49	6.37
3	银行类机构	802,196,215.65	6.36
4	基金类机构	797,242,444.80	6.32
5	银行类机构	507,096,943.14	4.02
6	银行类机构	507,001,620.71	4.02
7	银行类机构	503,083,894.83	3.99
8	银行类机构	503,076,062.86	3.99
9	银行类机构	501,372,634.82	3.98

10	银行类机构	500,000,000.00	3.96
----	-------	----------------	------

8.3 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	景顺长城景丰货币 A	10,579.03	0.00
	景顺长城景丰货币 B	-	-
	合计	10,579.03	0.00

注：分级基金管理人的从业人员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）。

8.4 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	景顺长城景丰货币 A	0~10
	景顺长城景丰货币 B	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城景丰货币 A	-
	景顺长城景丰货币 B	-
	合计	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城景丰货币 A	景顺长城景丰货币 B
基金合同生效日（2014 年 9 月 16 日）基金份额总额	447,036.01	305,813,591.11
本报告期期初基金份额总额	317,877,278.30	7,900,332,036.89
本报告期基金总申购份额	394,390,018.78	32,018,935,148.21
减：本报告期基金总赎回份额	467,276,853.21	27,211,508,719.64
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	244,990,443.87	12,707,758,465.46

注：总申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额，总赎回份额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

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人无重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

自 2019 年 1 月 22 日起，叶文煌先生担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，吴若曼女士不再担任基金托管人资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

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	
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注:1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下:

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

2、本基金本期交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	成交金额	占当期权 证 成交总额的 比例
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 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

2019 年 8 月 23 日