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:2015年8月29日

# 景顺长城景丰货币市场基金

## 2015 半年度 报告摘要

2015年6月30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2015年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本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2015年1月1日起至6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 | 1,890,413,737.91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 | 1,823,365.38份 | 1,888,590,372.53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 | 杨岬阳 | 张志永 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 | 021-62677777-212004 |
| | 电子邮箱 | investor@igwfmc.com | zhangzhy@cib.com.cn |
| 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.igwfmc.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

| 基金级别 | 景顺长城景丰货币A | 景顺长城景丰货币B |
|---|---|---|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日) | 报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 38,738.86 | 58,405,633.41 |
| 本期利润 | 38,738.86 | 58,405,633.41 |
| 本期净值收益率 | 2.1636% | 2.2844% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015年6月30日) | |
| 期末基金资产净值 | 1,823,365.38 | 1,888,590,372.53 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2015年6月30日) | |
| 累计净值收益率 | 3.3969% | 3.5919% |

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

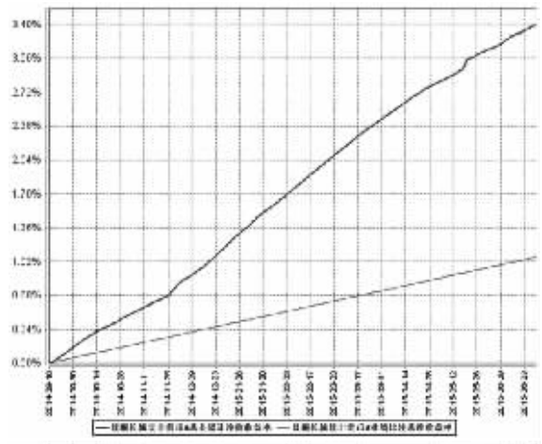
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.2555% | 0.0029% | 0.1110% | 0.0000% | 0.1445% | 0.0029% |
| 过去三个月 | 0.9219% | 0.0060% | 0.3366% | 0.0000% | 0.5853% | 0.0060% |
| 过去六个月 | 2.1636% | 0.0047% | 0.6695% | 0.0000% | 1.4941% | 0.0047% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.3969% | 0.0044% | 1.0652% | 0.0000% | 2.3317% | 0.0044% |

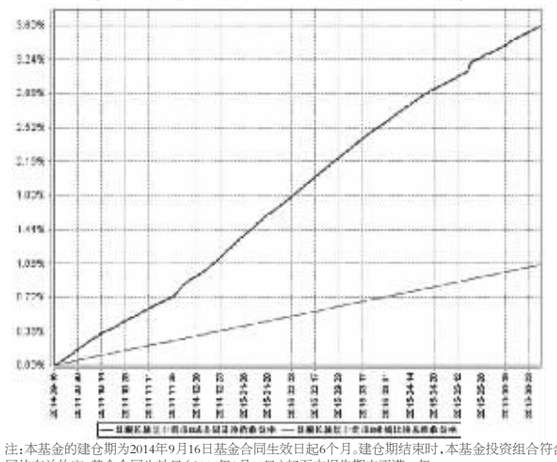
景顺长城景丰货币B

| 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 | 0.2752% | 0.0029% | 0.1110% | 0.0000% | 0.1642% | 0.0029% |
| 过去三个月 | 0.9828% | 0.0060% | 0.3366% | 0.0000% | 0.6462% | 0.0060% |
| 过去六个月 | 2.2844% | 0.0047% | 0.6695% | 0.0000% | 1.6149% | 0.0047% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.5919% | 0.0044% | 1.0652% | 0.0000% | 2.5267% | 0.0044% |

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。基金合同生效日(2014年9月16日)起至本报告期末不满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司,由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦(集团)有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立,并于2003年6月9日获得开业批文,注册资本1.3亿元人民币,目前,各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳,在北京、上海、广州设有分公司。

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

本公司采用团队投资方式,即通过整个投资部门全体人员的共同努力,争取良好投资业绩。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 毛从容 | 景顺长城稳健回报灵活配置混合型基金、领先回报灵活配置混合型基金、中国回报灵活配置混合型基金、安享回报灵活配置混合型基金、鑫月薪定期支付债券型基金、景颐双利债券型基金、景丰货币市场基金、景系列基金基金经理(分管景系列基金下设之景顺长城货币市场基金),固定收益部投资总监 | 2014年9月16日 | - | 15 | 经济学硕士。曾任职于交通银行、长城证券金融研究所,着重于宏观和债券市场的研究,并担任金融研究所债券业务小组组长。2003年3月加入本公司,担任研究员等职务;自2005年6月起担任基金经理。 |

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;

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

4.2 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修订)》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

本报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有1次,为公司旗下景顺长城量化精选股票型基金根据基金合同约定通过量化模型建仓从而与其他组合发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年上半年GDP 增速为7%,比2014年同期回落0.4 个百分点。其中工业增加值从3 月最低的5.6%,增速回升到6 月的6.8%。6 月固定资产投资增速累计同比是11.4%,与1-5 月持平,投资增速下滑态势得到抑制。1-6 月社会消费品零售总额累计同比10.4%,较2014年同期有所下降,处于近十年的历史低位。经济数据呈现温和企稳态势,包括PMI、工业增加值、固定资产投资、房地产开发投资等数据在6月份均有触底回升迹象。尽管猪肉价格持续上升,但4、5月份的CPI一直保持低位,通胀压力不大。社融与信贷增长仍旧低迷,显示信用扩张依旧不力。期间货币政策持续宽松,经过3次降息、3次降准,但由于信用传导不畅,过多的流动性淤积在银行间市场,资金面非常宽松。央行5月中下旬重启定向正回购,政策基调已逐渐由前期的总量放松逐渐转变为“锁短放长”和“定向货币放松”。受基本面和政策面的影响,债券收益率整体下行。短端下行幅度较大,长期利率因市场忧虑经济反弹及地方债供给压力,下行幅度较小。截止2015年6月末,与年初相比,1年期国开债下行117BP至2.78%, 1年期AA短融下行128BP至4.35%。期间虽然有新股因素的扰动,但银行间隔夜回购利率低点跌破1%,7天回购利率回落至2%以内。同业存款也大幅下行。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年上半年,景丰货币A净值收益率为2.1636%,高于业绩比较基准收益率1.4941%;景丰货币B净值收益率为2.2844%,高于业绩比较基准收益率1.6149%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然未来经济企稳的概率比较大,但是时点可能在3季度末。通胀在年内应该不是风险因素。从稳增长角度政策短期内还将以偏宽松为主,考虑到美联储可能的加息未来我们降准的可能性较大。展望2015年第3季度的债券市场,基本面和政策面决定债券市场方向将不变,二级市场股票的剧烈波动、新股IPO的收益率收窄,资金面的角度对债券市场相对有利。在政策没有转向之前我们认为短端资金利率会维持低位。预计7天回购利率的波动区间会在2.2-2.5%。策略上,剩余期限维持在较低水平,关注新股扰动时的资金波动机会,根据类别资产收益率的变化和相对吸引力进行动态调整。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

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

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后,将估值结果以双方认可的方式报给基金托管人,基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核,基金托管人复核无误后返回给基金管理人,由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时,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签署服务协议,由其提供银行间同业市场交易的债券品种的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同约定,本基金的收益分配方式为按月结转份额。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,本托管人在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了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

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。

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:2015年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | | 351,324,518.77 | 1,281,105,961.90 |
| 结算备付金 | | 1,798,000.00 | 5,287,500.00 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | | 1,091,746,539.12 | 210,602,623.00 |
| 其中:股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,091,746,539.12 | 210,602,623.00 |
| 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 | | 423,701,595.55 | 1,093,802,090.70 |
| 应收证券清算款 | | - | 10,009,997.22 |
| 应收利息 | | 25,081,676.34 | 11,641,471.53 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 100.00 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 1,893,652,429.78 | 2,612,449,644.35 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 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 | | 257,491.64 | 220,954.85 |
| 应付托管费 | | 68,664.42 | 58,921.32 |
| 应付销售服务费 | | 17,514.72 | 14,782.91 |
| 应付交易费用 | | 29,124.97 | 4,914.40 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | 2,663,645.59 | 5,995,742.00 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 202,250.53 | 112,500.00 |
| 负债合计 | | 3,238,691.87 | 6,407,815.48 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 1,890,413,737.91 | 2,606,041,828.87 |
| 未分配利润 | | - | - |
| 所有者权益合计 | | 1,890,413,737.91 | 2,606,041,828.87 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,893,652,429.78 | 2,612,449,644.35 |

注:1、报告截止日2015年6月30日,基金份额总额1,890,413,737.91份。其中A类基金份额净值1.0000元,基金份额总额1,823,365.38份;B类基金份额净值1.0000元,基金份额总额1,888,590,372.53份。

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:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | | 61,225,028.62 |
| 1.利息收入 | | 58,156,734.00 |
| 其中:存款利息收入 | | 30,404,383.14 |
| 债券利息收入 | | 9,839,527.05 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 17,912,823.81 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 3,068,294.62 |
| 其中:股票投资收益 | | - |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | | 3,068,294.62 |
| 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 | | 2,780,656.35 |
| 1.管理人报酬 | | 1,911,866.34 |
| 2.托管费 | | 509,830.94 |
| 3.销售服务费 | | 129,611.31 |
| 4.交易费用 | | - |
| 5.利息支出 | | 19,597.23 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 19,597.23 |
| 6.其他费用 | | 209,750.53 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 58,444,372.27 |
| 减:所得税费用 | | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 58,444,372.27 |

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:2015年1月1日 至 2015年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 2,606,041,828.87 | - | 2,606,041,828.87 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 58,444,372.27 | 58,444,372.27 |
| 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) | -715,628,090.96 | - | -715,628,090.96 |
| 其中:1.基金申购款 | 259,931,356.19 | - | 259,931,356.19 |
| 2.基金赎回款 | -975,559,447.15 | - | -975,559,447.15 |
| 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) | - | -58,444,372.27 | -58,444,372.27 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,890,413,737.91 | - | 1,890,413,737.91 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

_____许义明_____ _____吴建军_____ _____邵媛媛_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城景丰货币市场基金(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》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,通知存款,短期融资券,一年以内(含一年)的银行定期存款、协议存款、大额存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据,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2015年8月27日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《景顺长城景丰货币市场证券投资基金基金合同》 和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年1月1日至2015年6月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年上半年的财务状况以及2015年1月1日至2015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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

6.4.7 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、注册登记机构、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 |

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

本基金本期未通过关联方交易单元进行交易。

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 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 | 1,911,866.34 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 4,371.99 |

注:支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.15%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X0.15%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 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 | 509,830.94 |

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X0.04%/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 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 | 623.94 | 127,368.24 | 127,992.18 |
| 兴业银行 | 1,619.13 | 54.06 | 1,673.19 |
| 合计 | 2,243.07 | 127,422.30 | 129,665.37 |

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 2015年1月1日至2015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 | 50,016,915.57 | - | - | - | - | - |

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

本基金的基金管理人于本报告期未运用固有资金投资本基金。

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

除基金管理人之外,本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

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 2015年1月1日至2015年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 兴业银行-活期存款 | 3,324,518.77 | 57,140.55 |
| 兴业银行-定期存款 | - | 6,447,444.49 |

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。存入兴业银行的定期存款按照约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2015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

本基金本期未无因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末无暂时停牌等流通受限的股票。

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。

6.4.9.3.2 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。

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2015年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为1,091,746,539.12元,无属于第一或第三层次的余额(2014年12月31日:第二层次210,602,623.00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2015年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 固定收益投资 | 1,091,746,539.12 | 57.65 |
| | 其中:债券 | 1,091,746,539.12 | 57.65 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 423,701,595.55 | 22.37 |
| | 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 | 353,122,518.77 | 18.65 |
| 4 | 其他各项资产 | 25,081,776.34 | 1.32 |
| 5 | 合计 | 1,893,652,429.78 | 100.00 |

注:银行存款和结算备付金中包含定期存款348,000,000.00元。

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | | 0.10 |
| | 其中:买断式回购融资 | |