景顺长城货币市场证券投资基金 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:中国银行股份有限公司
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。

基金托管人中国银行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		
场内简称	无		
基金主代码	260102		
交易代码	260102		
系列基金名称	景顺长城景系列开放式证券投资基金		
系列其他子基金名称	景顺长城动力平衡混合(260103)、景顺长城优选混合(260101)		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2003年10月24日		
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	3,193,284,485.28份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称;	景顺长城货币A	景顺长城货币B	
下属分级基金的交易代码;	260102	260202	
报告期末下属分级基金的份额总额	217,457,962.57份	2,975,826,522.71份	

2.2 基金产品说明

投资目标	货币市场基金在保持本金的高流动性和安全性的前提下,获得高于基准的投资回报。
投资策略	本基金通过宏观经济、政策和市场资金供求的综合分析进行短期利率判断,对各投资品种从收益率、流动性、信用风险、平均剩余期限等方面进行综合价值比较,在保持基金资产高流动性的前提下构建组合。
业绩比较基准	税后同期7天存款利率。
风险收益特征	本基金具有较高风险和较高收益的特点,投资目标是在保持本金的高流动性和安全性的前提下,获得高于基准的投资回报。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨柳和	王永民
	联系电话	0755- 82370388	010- 66594896
	电子邮箱	investor@jwfmc.com	fcid@bank.ofchina.com
客户服务电话		4008888606	95566
传真		0755- 22381339	010- 66594942

2.4 信息披露方式

信息披露全年度报告正文的管理人互联网网址	www.jwfmc.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 期末数据和指标	2016年		2015年		2014年	
	景顺长城货币A	景顺长城货币B	景顺长城货币A	景顺长城货币B	景顺长城货币A	景顺长城货币B
本期已实现收益	4,800,100.24	8,439,779.98	12,916,713.25	35,397,052.13	14,930,240.69	50,976,618.57
本期利润	4,800,100.24	8,439,779.98	12,916,713.25	35,397,052.13	14,930,240.69	50,976,618.57
本期净值收益率	2.1350%	2.3802%	3.1473%	3.3953%	4.1998%	4.4489%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
期末基金资产净值	217,457,962.57	2,975,826,522.71	278,196,603.89	494,343,646.60	888,288,980.02	1,789,735,324.18
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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

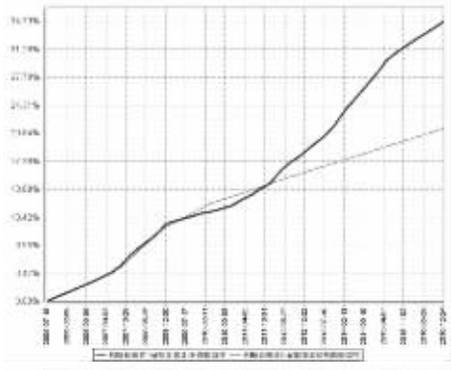
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5698%	0.0018%	0.3393%	0.0000%	0.2305%	0.0018%
过去六个月	1.0955%	0.0021%	0.6787%	0.0000%	0.4168%	0.0021%
过去一年	2.1350%	0.0029%	1.3500%	0.0000%	0.7850%	0.0029%
过去三年	9.7734%	0.0065%	4.0500%	0.0000%	5.7234%	0.0065%
过去五年	17.4425%	0.0060%	6.8178%	0.0001%	10.6247%	0.0059%
自基金合同生效起至今	34.7355%	0.0064%	21.4363%	0.0021%	13.2992%	0.0043%

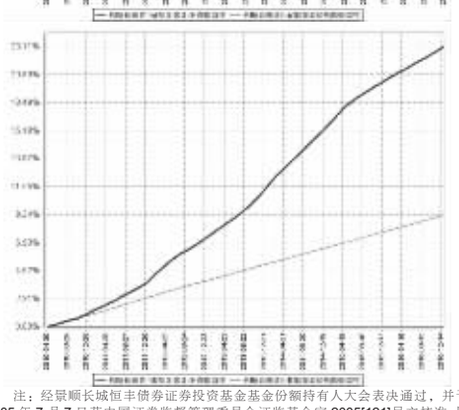
景顺长城货币 B

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
过去三个月	0.6304%	0.0018%	0.3393%	0.0000%	0.2911%	0.0018%
过去六个月	1.2175%	0.0021%	0.6787%	0.0000%	0.5388%	0.0021%
过去一年	2.3802%	0.0029%	1.3500%	0.0000%	1.0302%	0.0029%
过去三年	10.5653%	0.0065%	4.0500%	0.0000%	6.5153%	0.0065%
过去五年	18.8557%	0.0060%	6.8178%	0.0001%	12.0379%	0.0059%
自基金合同生效起至今	23.1101%	0.0063%	9.1873%	0.0001%	13.9228%	0.0062%

注:本基金的收益分配为每日分配,按月结转份额。

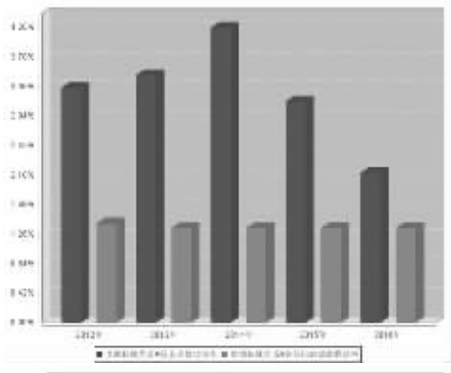
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

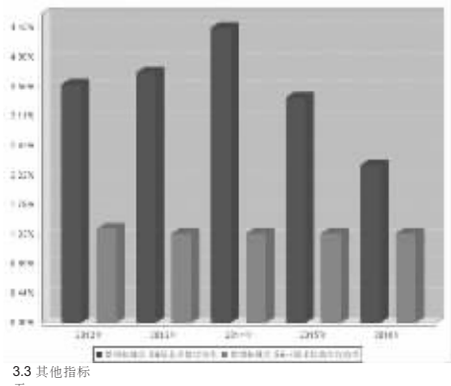




注:经景顺长城恒丰债券证券投资基金基金份额持有人大会表决通过,并于 2005 年 7 月 7 日获中国证券监督管理委员会证监基金字 2005[121]号文核准,景顺长城恒丰债券证券投资基金以 2005 年 7 月 14 日为转变基准日转变成为景顺长城货币市场证券投资基金。本基金自 2010 年 4 月 30 日起实行基金份额分级。

3.2.3 过去五年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





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

景顺长城货币A					
年度	已实现投资形式转实收基金	直接通过应付期末份额转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016	4,519,283.76	345,301.01	- 64,484.53	4,800,100.24	
2015	11,204,962.79	2,415,679.52	- 703,919.06	12,916,713.25	
2014	13,835,246.38	1,162,649.98	- 67,655.67	14,930,240.69	
合计	29,559,492.93	3,923,630.51	- 836,059.26	32,647,054.18	

单位:人民币元

景顺长城货币B					
年度	已实现投资形式转实收基金	直接通过应付期末份额转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016	6,171,116.34	880,736.66	1,387,926.98	8,439,779.98	
2015	27,565,624.38	9,085,875.80	- 1,254,448.05	35,397,052.13	
2014	46,743,846.49	5,336,159.05	- 1,103,386.97	50,976,618.57	
合计	80,480,587.21	15,302,771.51	- 989,908.04	94,813,450.68	

§ 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、景顺长城景颐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		
毛从容	本基金的基金经理、公司副总经理	2005年6月1日	2016年4月25日	16年	经济学硕士。曾任职于交通银行、长城证券金融研究所,著有《宁愿和猪作邻居吗?》,并担任金融研究所博士后小组组长。2003年3月加入本公司,担任研发总监等职务;自2005年6月起担任基金经理。
陶威霖	本基金的基金经理	2016年4月20日	-	5年	管理学硕士。曾担任平安证券研究所分析员等职务;自2013年6月加入本公司,先后担任交易管理部交易员、固定收益部投资经理;自2016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、《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》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,同时对投权、研究分析与投决策、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

所有投资对象的投资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

相对于去年稳健偏宽松的货币政策, 今年 1、2 季度以来央行的货币政策逐步趋于实质稳健,到 3、4 季度稳健略偏紧。首先,货币政策调控从数量型调控向价格型调控转变,着重培育基准利率,打造利率走廊机制。公开市场 7 天逆回购利率逐步成为政策利率,和常备借贷便利(SLF)利率引导短期货币市场。而中长期利率方面,以中期借贷便利(MLF)利率引导市场。其次,在货币政策工具的选择上,与去年发生显著变化的是,供给侧改革力度加大背景下,今年以来央行倾向运用公开市场逆回购,或是定向比如常备借贷便利(SLF)、中期借贷便利(MLF)、抵押补充贷款(PSL)的货币政策工具来取代降准降息等宽松信号过于强烈的工具来供给流动性。特别是 3 季度以来,虽然货币政策执行报告中提出货币政策将在稳增长和防泡沫中寻求平衡,从量、期限、价格来分析近期央行操作来看,央行目前政策重点已经转向了防泡沫。7 天公开市场操作利率这一政策性利率继续维持 2.25%不变。SLF 利率与 MLF 利率也并未松动。3 季度开始一系列的缩短放长操作后市场整体融资成本大幅上行。而由于今年以来金融体系中银行负债端对于银行间资金的依赖程度上升,负债端不稳定,因此在货币市场收益率持续紧张时,期限错配问题带动了整体负债端连锁反应致使收益率大幅抬升,以继续维持资产端。组合在报告期内上半年考虑季节性因素带来的资金波动风险采用中性偏短久期策略,下半年考虑偏紧货币政策下的流动性风险及利率风险采用短久期策略。秉承为持有人提供安全稳定的长期回报为目标,配置上以短久期信用品种,存款及短期限回购为主。信用产品选择上,始终优选 AAA 评级中高流动性、现金流好且负债率较低的个体。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年度,景顺货币 A 份额净值收益率为 2.1350%,业绩比较基准收益率为 1.3500%; 景顺货币 B 份额净值收益率为 2.3802%, 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

预计 2017 年经济弱企稳, 全年增速有望保持 6.5%;1 季度通胀数据维持高位,将继续强化市场的通胀预期;政策层面将以稳健货币政策与积极财政政策相结合,货币政策将持续开展缩短放长操作,进一步调整金融体系融资结构,降低金融杠杆及期限错配风险,财政政策赤字率提升空间有限,未来期待 PPP 准财政加速发力。海外方面,美联储加息,美元强势通过汇率影响国内利率水平。基本面及政策面对债券市场均不利,利率债需等待利空因素释放后才有较好的交易性机会。信用债方面,2016 年在委外资金的推动下,以广义基金为主力的配置力量是拉低信用债收益率及利差的主要因素;但在加强理财监管的大趋势下,2017 年表外理财增速将受影响,广义基金的配置压力将大大缓解,处于历史底位的信用利差有抬升压力。

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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在景顺长城货币市场证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《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有关规定,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,本托管人根据《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,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、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:景顺长城货币市场证券投资基金

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	1,481,336,211.82	240,059,330.06
结算备付金	-	809,523.81
存出保证金	-	-
交易性金融资产	429,600,432.87	360,123,266.41
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	429,600,432.87	360,123,266.41
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	1,139,572,309.36	170,000,905.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	7,503,132.39	4,438,850.39
应收股利	-	-
应收申购款	138,218,637.83	109,388.12
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,196,230,724.27	775,541,263.79
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	55,855.25	376,015.03
应付管理人报酬	250,771.03	260,015.80
应付托管费	75,991.22	78,792.61
应付销售服务费	47,053.54	65,813.42
应付交易费用	20,145.33	22,760.14
应交税费	59,200.00	59,200.00
应付利息	-	-
应付利润	2,324,676.32	1,001,233.87
递延所得税负债	-	-
其他负债	112,546.30	137,182.63
负债合计	2,946,238.99	2,001,013.30
所有者权益:		
实收基金	3,193,284,485.28	773,540,250.49
未分配利润	-	-
所有者权益合计	3,193,284,485.28	773,540,250.49
负债和所有者权益总计	3,196,230,724.27	775,541,263.79

注:报告截止日 2016 年 12 月 31 日,基金份额总额 3,193,284,485.28 份。其中 A 类基金份额净值 1.0000 元,基金份额总额 217,457,962.57 份;B 类基金份额净值 1.0000 元,基金份额总额 2,975,826,522.71 份。

7.2 利润表

会计主体:景顺长城货币市场证券投资基金

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1月1日至2015年12月31日
一、收入	16,541,268.58	56,478,139.24
1.利息收入	16,065,183.08	55,380,521.37
其中:存款利息收入	5,303,322.49	18,964,531.51
债券利息收入	5,953,211.37	24,355,106.44
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,808,649.22	12,060,883.42
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"号填列)	476,085.50	1,097,617.87
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	476,085.50	1,097,617.87
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	3,301,388.36	8,164,373.86
1. 管理人报酬	1,814,719.60	5,093,523.58
2. 托管费	548,914.99	1,543,492.03
3. 销售服务费	604,351.15	1,137,572.43
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	64,538.29	75,457.47
其中:卖出回购金融资产支出	64,538.29	75,457.47
6. 其他费用	267,866.33	314,328.35
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	13,239,880.22	48,313,765.38
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	13,239,880.22	48,313,765.38

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:景顺长城货币市场证券投资基金

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)	773,540,250.49	-	773,540,250.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,239,880.22	13,239,880.22
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)	2,419,744,234.79	-	2,419,744,234.79
其中:1.基金申购款	5,417,823,606.48	-	5,417,823,606.48
2.基金赎回款	- 2,998,079,371.69	-	- 2,998,079,371.69
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)	-	- 13,239,880.22	- 13,239,880.22
五、期末所有者权益(基金净值)	3,193,284,485.28	-	3,193,284,485.28

项目	上年度可比期间 2015年1月1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)	2,658,024,304.20	-	2,658,024,304.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	48,313,765.38	48,313,765.38
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)	- 1,884,484,053.71	-	- 1,884,484,053.71
其中:1.基金申购款	10,506,422,586.29	-	10,506,422,586.29
2.基金赎回款	- 12,390,906,640.00	-	- 12,390,906,640.00
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)	-	- 48,313,765.38	- 48,313,765.38
五、期末所有者权益(基金净值)	773,540,250.49	-	773,540,250.49

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

景顺长城景系列开放式证券投资基金(以下简称"本系列基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2003]第 96 号《关于同意景顺长城景系列开放式证券投资基金设立的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 10 月 24 日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设三个子基金,分别为景顺长城货币市场证券投资基金 (2005 年 7 月 15 日前原为景顺长城恒丰债券证券投资基金,以下简称"本基金")、景顺长城优选股票证券投资基金和景顺长城动力平衡证券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,835,000,215.28 元,其中包括景顺长城恒丰债券证券投资基金人民币 473,468,816.63 元、景顺长城优选股票证券投资基金人民币 820,829,988.03 元和景顺长城动力平衡证券投资基金人民币 540,701,410.62 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2003)第 144 号验资报告予以验证。本系列基金设立募集期内认购资金产生的银行利息人民币 782,418.90 元在基金募集期结束时计入投资者认购账户,折合成 782,418.90 份基金份额,其中景顺长城恒丰债券证券投资基金 258,742.20 份基金份额、景顺长城优选股票证券投资基金 262,508.27 份基金份额和景顺长城动力平衡证券投资基金 261,168.43 份基金份额,归投资者所有。

根据基金管理人 2005 年 7 月 12 日发布的《关于景顺长城恒丰债券证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》(以下简称"公告"),景顺长城恒丰债券证券投资基金的基金份额持有人大会于 2005 年 6 月 13 日表决通过了《关于景顺长城恒丰债券证券投资基金转变为景顺长城货币市场证券投资基金的议案》,并于 2005 年 7 月 7 日获得了中国证监会证监基金字[2005]121 号《关于核准景顺长城恒丰债券证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》。根据《关于景顺长城恒丰债券证券投资基金转变为景顺长城货币市场证券投资基金的议案》的有关规定,确定 2005 年 7 月 14 日为景顺长城恒丰债券证券投资基金的基金转变基准日,景顺长城恒丰债券证券投资基金需在此之前调整资产结构使之满足景顺长城货币市场证券投资基金的要求。

经普华永道中天会计师事务所有限公司审计 (普华永道中天审字 (2005)第 1720 号审计报告),截至 2005 年 7 月 14 日止,景顺长城恒丰债券证券投资基金基金净值 81,561,919.51 元, 于 2005 年 7 月 15 日按照本基金固定交易单位面值 1.00 元转变为本基金的基金净值和基金份额。景顺长城恒丰债券证券投资基金相关的资产和负债根据公告中规定的转变会计处理方法以直接结转和非直接结转的方法分别转变为本基金的资产和负债。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行股份有限公司。

根据《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城景系列开放式证券投资基金下设的货币市场证券投资基金实施基金份额分级和变更业绩比较基准并修改相关基金合同的公告》,自 2010 年 4 月 30 日起,本基金将基金份额分为 A 级和 B 级,不同级别的基金份额适用不同费率的销