（上接B063版）

（89）嘉实财富管理有限公司
注册（办公）地址：上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期4606-10单元
法定代表人：赵学军
联系人：景琪
电话：021-20289890
传真：010-85097308
客户服务电话：400-021-8850
网址：www.harvestwm.cn
（90）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区宣武门外大街10号庄胜广场中央办公楼东翼7层
法定代表人：杨懿
电话：0755-88394666
传真：0755-88394677
客户服务电话：400-166-1188
网址：http://8.jrjcom.cn/
（91）一路财富（北京）信息科技有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人：吴雪秀
联系人：段京璐
电话：010-88312877
传真：010-88312885
客户服务电话：400-001-1566
网址：www.yilucaifu.com
（92）北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人：梁越
联系人：陈攀
电话：010-57756019
传真：010-57756199
客户服务电话：400-786-8868-5
网址：www.chtfund.com
（93）北京钱景财富投资管理有限公司
注册（办公）地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人：赵荣春
联系人：魏争
电话：010-57418829
传真：010-57569671
客户服务电话：400-678-5095
网址：www.niuji.net
（94）深圳腾元基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806单元
办公地址：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806单元
法定代表人：曾革
联系人：鄢萌莎
电话：0755-33376853
传真：0755-33065516
客户服务电话：4006-877-899
网址：www.tenyuanfund.com
（95）北京创金启富投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人：梁蓉
联系人：张晶晶
电话：010-66154828
传真：010-88067526
客户服务电话：010-88067525
网址：www.5irich.com
（96）北京国鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦A303
法定代表人：王岩
联系人：胡明会
电话：010-59200855
传真：010-59200800
客户服务电话：400-819-9868
网址：www.tdyhfund.com
（97）上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
办公地址：上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人：张皞
联系人：周丹
电话：021-33323999
传真：021-33323993
客户服务电话：400-820-2819
手机客户端：天天盈基金
（98）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：沈继伟
联系人：赵沛然
电话：021-50583533
传真：021-50583633
客户服务电话：4000676266
公司网址：www.leadbank.com.cn
（99）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册（办公）地址：北京市海淀区北四环西路58号906室
法定代表人：张欢行
联系人：李昭琛
电话：010-82244185
客户服务电话：010-62675369
网址：http://www.xincai.com/
（100）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册（办公）地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人：林卓
联系人：薛长平
电话：0411-88891212
传真：0411-84396536
客户服务电话：4006411999
网址：www.taichengcaifu.com
（101）上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：郭坚联系人：宁博宇
电话：021-20665952
传真：021-22066653
客户服务电话：4008219031
网址：www.lufunds.com
（102）深圳富济财富管理有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址：深圳市南山区高新技术产业园南七道惠恒集团二期418室
法定代表人：齐小贺
联系人：马力佳
电话：0755-83999907-815
传真：0755-83999926
客户服务电话：0755-83999907
网址：www.jinqianwo.cn
（103）北京乐融多源投资咨询有限公司
注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1楼1603
办公地址：北京市朝阳区西大望路1号温特莱中心A座16层
法定代表人：董浩
联系人：于婷婷
电话：010-56409010
客户服务电话：400-068-1176
网址：www.jimufund.com
（104）珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人：肖雯
联系人：黄敏嫦
电话：020-89629099
传真：020-89629011
客户服务电话：020-89629066
网址：www.yingmi.cn
基金管理人可根据《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。
（二）注册登记人
名称：景顺长城基金管理有限公司
住所：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
法定代表人：赵如冰
电话：（0755）82370388-1668
传真：（0755）22381325
联系人：杨波
（三）律师事务所及经办律师
名称：北京市金诚同达律师事务所
住所：北京建国门外大街甲24号东海中心17层
负责人：田予
电话：（010）65155566
传真：（010）65263519
经办律师：贺宝银、徐志浩
（四）会计师事务所及经办注册会计师
法定名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：俞伟敏
经办注册会计师：单峰、俞伟敏
四、基金的名称
景顺长城景系列开放式证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式
六、货币市场基金份额的分级
本系列基金下设货币市场基金自2010年4月30日起实行基金份额分级，根据投资者持有货币市场基金的份额等级适用不同的销售服务费率。自2010年4月30日起，货币市场基金分设两级基金份额：A级基金份额和B级基金份额。两级基金份额分设不同基金代码，两级基金份额单独公布每万份基金净收益和基金七日年化收益率。
基金费率及分级规则
1、A级与B级基金份额的交易限额和适用费率如下表所示：

	A级基金份额	B级基金份额
申购费	0	0
赎回费	0	0
销售服务费	0.25%	0.01%
首次申购最低金额	1元	1元
追加申购最低金额	不限	不限
定期定额申购最低金额	1元	不适用
单笔赎回最低限额	0.01份	0.01份
单个基金账户保留的最低持有份额	不适用	500万份
在销售机构保留的最低持有份额	1份	1份

注：货币市场基金当期基金收益结转基金份额，不受最低申购金额的限制，货币市场基金B级基金份额暂不开通定期定额投资计划。
2、份额分级规则：
基金份额分级后，在基金存续期内的任何一个开放日，单个基金账户内保留的货币市场基金份额超过500万份（包含500万份）时，注册登记机构将自动升级其单个基金账户内持有的可用基金份额为B级基金份额，未结转收益将不结转，一并带入B级份额，并于升级当日适用B级的相关费率。
基金份额分级后，在基金存续期内的任何一个开放日，单个基金账户内保留的货币市场基金份额低于500万份（不含500万份）时，注册登记机构将自动降级其单个基金账户内持有的可用基金份额为A级基金份额，未结转收益将不结转，一并带入A级份额，并于降级当日适用A级的相关费率。
基金份额分级规则自2010年4月30日起生效，自该日起，注册登记机构将根据投资者基金账户所持有的货币市场基金份额数量，进行份额级别判断和处理，并适用A、B级相关费率。
基金份额分级后，对在开放日参与基金份额升降级确认的投资者，其在当日提交的货币市场基金转换转出、转托管转出等申请，注册登记机构将在下一开放日做失败确认处理。
七、基金的转换
（一）本系列基金的转换费用
本系列基金的转换费用由赎回费和申购补差费组成，转出时收取赎回费，转入时收取申购补差费。其中赎回费的收取标准遵循本招募说明书的约定，申购补差费的收取标准为：申购补差费= MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用－转出净额在转出基金中对应的申购费用，0】。
（二）转换交易的计算方式
本系列基金的转换交易包括了基金转出和基金转入，其中：
①基金转出时赎回费的计算：
由优选混合型基金或动力平衡基金转出时：
转出总额＝转出份额×转出基金当日基金份额净值
由货币基金转出时：
转出总额＝转出份额×转出基金当日基金份额净值+待结转收益（全额转出时）
赎回费用＝转出总额×转出基金赎回费率
转出净额＝转出总额－赎回费用
②基金转入时申购补差费的计算：
净转入金额＝转出净额－申购补差费
其中，申购补差费= MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用－转出净额在转出基金中对应的申购费用，0】
转入份额＝净转入金额 / 转入基金当日基金份额净值
例：投资者申请将持有的优选混合型基金10,000份转换为景顺长城内需增长开放式证券投资基金，假设转换当日优选混合型基金的基金份额净值为1.148元，投资者持有该基金18个月，对应赎回费为0.25%，申购费为1.5%，内需增长基金的基金份额净值为1.163元，申购费为1.5%，则投资者转换后可得到的内需增长基金份额为：
转出总额＝10,000×1.148＝11,480元
赎回费用＝11,480×0.25%＝28.70元
转出净额＝11,480－28.7= 11,451.3元
转出净额在转入基金中对应的净申购金额＝11,451.3/1.015=11,282.07元
转出净额在转入基金中对应的申购费用＝11,451.3-11,282.07=169.23元
转出净额在转出基金中对应的净申购金额＝11,451.3/1.015=11,282.07元
转出净额在转出基金中对应的申购费用＝11,451.3-11,282.07=169.23元
净转入金额＝11,451.3－MAX【169.23－169.23，0】=11,451.3元
转入份额＝11,451.3 / 1.163＝9,846.34份
八、基金的投资目标
本系列基金的投资目标是：运用专业化的投资管理，为投资者提供长期稳定并可持续的资本增值。各基金投资目标如下：
1、优选混合型基金利用“景顺长城股票数据库”对股票进行精密和系统的分析，构建具有投资价值的股票组合，力求为投资者提供长期的资本增值。
2、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。
3、动力平衡基金以获取高于业绩比较基准的回报为目标，注重通过动态的资产配置以达到当期收益与长期资本增值的兼顾，争取为投资者提供长期稳定的回报。
九、基金的投资方向
本系列基金下设的优选混合型基金和动力平衡基金的投资范围包括股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票投资范围包括所有在国内依法公开发行上市的A股；债券投资的范围包括国债、金融债、企业债与可转换债券等。
本系列基金下设的货币市场基金投资于以下金融工具：
1、现金；
2、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；
3、剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券；
4、期限在一年以内（含一年）的债券回购；
5、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；
6、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。
十、基金的投资策略
1、资产配置
本系列基金下优选混合型基金和动力平衡基金均有债券和股票资产，但是配置比例显著不同：

优选混合型基金	动力平衡基金
股票：70-80% 债券：20-30%	股票：20-80% 债券：20-80%

*百分比为占基金资产净值比例。
2、优选混合型基金和动力平衡基金的股票选择及组合构建
（1）投资流程
在构建和管理投资组合过程中，这两只基金主要采取“自下而上”的投资策略，着重选择基本面良好或价值被过分低估的股票。同时，也会结合“自上而下”的投资策略，即基于对宏观经济运行状况及政策分析、金融货币运行状况及政策分析、产行业运行景气状况及政策分析，做出产行业偏好选择，进而结合证券市场状况和政策分析，做出资产配置及组合构建的决定。
（2）选股原则
股票投资以成长、价值及收益为基础，在合适的价位买入具有高成长性的成长型股票、价值被市场低估的价值型股票以及能提供稳定收益的收益型股票。
（3）选股程序
①通过“景顺长城股票数据库”的详细分析与其他深入的研究，如实地考察、电话会议、行业分析等，判断股票是否值得投资，然后组建“股票买进名单”；
②在深入研究的基础上（包括对各种量化指标的分析，结合各券商的投资分析报告），综合公司的分析判断，做出对所研究股票的投资结论，并持续维护“股票买进名单”；
③根据基金的投资目标、投资限制和投资策略等要求，考虑收益和风险的配比、股票的流动性以及其它因素，推荐不同基金的股票买进名单。
3、债券选择和组合构建
（1）投资流程
本系列基金下各基金债券投资部分着重本金安全性和流动性。综合分析宏观经济形势，并对货币政策与财政政策以及社会政治状况等进行研究，着重利率的变化趋势预测，建立对收益率曲线变动的预测模型。通过该模型进行估值分析，确定价格中枢的变动趋势；同时，计算债券投资组合久期、到期收益率和期限等指标，进行“自下而上”的选券和债券品种配置。
（2）债券投资组合管理
①组合久期管理：为了充分地控制利率变动风险，需要及时对债券投资组合进行调整。当预测利率将上升时，本系列基金将缩短组合债券的平均久期、持有短期债券、浮动债等来减低利率风险；反之，当预测利率将下降时，本系列基金将增大组合的平均久期并增持长期债券来提高组合的收益水平。在组合久期确定后，本系列基金将通过不同期限债券的匹配组合，从价格的相对变化中获得较高的收益。
②资产配置：在未来利率走势预期的基础上，本系列基金通过久期与凸性管理的手段，在不同期限的债券以及固息债与浮息债之间进行配置。同时，本系列基金以市场规模、收益率与流动性为基础，在不同市场以及不同的债券类别之间进行配置。
③债券选择
本系列基金在考虑信用质量和期限等因素后，将选择以下类型的债券：
●到期收益率较高、具有较好流动性的债券
●有较高当期收入的债券
●有增值潜力、价格被低估（即收益率和久期过分偏离合理水平）的债券
●预期信用质量将得到改善的金融债或企业债券
●期权和债性突出的可转换债
●收益率水平合理的新券或者市场尚未正确定价的创新品种
④组合构建：本系列基金通过宏观经济分析，对利率走势做出判断，在此基础上对各类资产进行合理配置。同时，本系列基金根据收益率和流动性、债券资质“自下而上”地进行个券选择，组成最终的投资组合。在确定具体个券后，须依据下列标准构建投资组合：
●确保执行投资策略并确保投资组合久期在规定的范围内
●保持投资组合分散化，基金持有单一债券品种不得超过基金净值的10%
●保持投资组合的流动性，以满足基金正常现金流的需要
●控制投资组合风险在一定的范围内
●债券投资组合中，债券信用等级最低为BBB+或同等信用，投资组合的平均信用等级应在AA+或以上
⑤组合优化：在债券组合管理中开发出独有的程序对债券组合定期进行量化分析，包括精确计算组合的VAR值、贡献分析、跟踪误差等指标，根据量化分析结果对债券组合品种进行相应的配置调整，并通过了解组合的风险特征、预算，按照宏观经济分析模型预测和企业信用分析的结果，对组合做出连续的优化调整。
⑥现金和回购资产：保留足够的现金以应付基金日常的现金需要。
4、货币市场基金的投资决策程序和方法：
（1）投资决策程序
①基金经理依据投资部对宏观经济、货币政策、财政政策以及市场资金供求状况的综合分析，对短期利率变化趋势做出判断，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议；
②投资决策委员会审核基金经理提交的资产配置建议，并最终决定资产配置方案；
③基金经理对各投资品种进行收益率、流动性、信用风险、平均剩余期限分析，同时根据未来利率变化的预期以及投资品种的利率敏感性来综合评定各品种的投资价值；
④基金经理结合经审定的资产配置方案、基金日常申购、赎回情况进行具体的投资组合构建。
⑤投资决策委员会审核重大基金投资组合方案，如无异议，由基金经理具体执行投资计划。
（2）投资管理方法
①深入分析宏观经济、货币政策和市场资金供求变化，对短期利率走势形成合理预期，并据此调整基金的资产配置策略。
②通过利率预期策略，确定组合的平均剩余期限和各类资产的配置比例。
③通过流动性管理策略，在保持基金资产高流动性的前提下，确保基金的稳定收益。
④以严谨的研究分析为基础，积极实施时机策略。
本系列基金会持续地进行定期与不定期的投资组合回顾与风险监控，适时做出相应调整。
十一、基金的业绩比较基准
优选混合型基金：上证综合指数和深证综合指数的加权复合指数×80%＋中国债券总指数×20%。
货币市场基金：自2010年4月30日起，本基金的业绩比较基准由原先的“税后一年期定期存款利率”变更为“税后同期7天存款利率”。当市场上有更加适合的业绩比较基准，在不损害投资者利益的前提下，基金管理人有权按照相关规定对本基金的业绩比较基准进行变更并公告。
动力平衡基金：自2010年1月29日起，动力平衡的业绩比较基准由原先的“一年期银行定期存款年利率的2倍”变更为“沪深300指数收益率×50%＋中国债券总指数收益率×45%＋ 银行同业存款收益率×5%”。
如果今后市场出现更具代表性的业绩比较基准，在与基金托管人协商一致后，本基金管理人可调整或变更业绩比较基准。
十二、基金的风险收益特征
优选混合型基金是一种具有较高波动性和较高风险的投资工具。适合风险承受能力强、追求高投资回报的投资群体。
货币市场基金具有低风险和收益稳定的特点，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。
动力平衡基金是一种具有中等风险的投资工具，除了结合以上景顺长城股票及债券基金的风险管理程序以外，为达到平稳回报的目的，该基金还将独立地对风险来源进行评估，并设立额外的风险控制管理手段。
十三、基金投资组合报告（未经审计）
景顺长城基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定，已经复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。
优选混合型基金投资组合报告
1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	939,139,228.54	73.68
	其中：股票	939,139,228.54	73.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	261,713,500.00	20.53
	其中：债券	261,713,500.00	20.53
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	65,598,054.32	5.15
8	其他资产	8,199,729.93	0.64
9	合计	1,274,650,512.79	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	469,387,897.28	36.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	103,662,583.20	8.15
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	46,469,424.79	3.66
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	111,369,802.28	8.76
J	金融业	-	-
K	房地产业	51,574,676.16	4.06
L	租赁和商务服务业	81,306,485.31	6.40
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	75,368,359.52	5.93
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	939,139,228.54	73.88

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000958	东方能源	3,926,613	103,662,583.20	8.15
2	300058	蓝色光标	7,167,993	76,482,485.31	6.02
3	300145	南方泵业	1,879,352	62,864,324.40	4.95
4	002311	海大集团	4,968,496	58,777,296.85	4.62
5	300009	安科生物	2,694,944	58,776,728.64	4.62
6	300232	洲明科技	2,757,832	56,535,556.00	4.45
7	600240	华业资本	4,847,244	51,574,676.16	4.06
8	002292	奥飞动漫	1,712,668	50,112,665.68	3.94
9	002037	久联发展	1,969,662	47,035,528.56	3.70
10	002354	天神娱乐	584,703	43,881,960.15	3.45

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	261,713,500.00	20.59
	其中：政策性金融债	261,713,500.00	20.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	261,713,500.00	20.59

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	150211	15国开11	800,000	80,248,000.00	6.31
2	140305	14进出05	550,000	55,544,500.00	4.37
3	110417	11农发17	500,000	50,760,000.00	3.99
4	140230	14国开30	250,000	25,055,000.00	1.97
5	150411	15农发11	200,000	20,064,000.00	1.58

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
9.2 本基金投资股指期货的投资政策
根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。
10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1 本期国债期货投资政策
根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。
11. 投资组合报告附注
11.1
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。
11.2
本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	959,864.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,262,473.09
5	应收申购款	977,392.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,199,729.93

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300058	蓝色光标	76,482,485.31	6.02	因重大事项停牌
2	300145	南方泵业	62,864,324.40	4.95	因重大事项停牌，已于2015年10月9日复牌

货币市场基金投资组合报告
12. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	580,381,960.30	30.10
	其中：债券	580,381,960.30	30.10
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	408,401,412.60	21.18
	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	925,388,823.55	47.99
4	其他资产	14,177,621.98	0.74
5	合计	1,928,349,818.43	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919,000,000.00元。
13. 报告期债券回购融资情况

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	0.12
	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%。
14. 基金投资组合平均剩余期限
14.1 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	30
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	45
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

报告期内投资组合平均剩余期限超过180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180天。
14.2 报告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	69.77	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	16.68	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	6.23	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	6.77	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.45	-

15. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	150,298,603.18	7.81
	其中：政策性金融债	150,298,603.18	7.81
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	430,083,357.12	22.34
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	580,381,960.30	30.15
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

16. 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	150202	15国开02	500,000	50,174,779.14	2.61
2	011547001	15华润SCP001	500,000	50,069,009.14	2.60
3	011507003	15南电SCP003	500,000	50,005,140.68	2.60
4	011513002	15招商局SCP002	500,000	50,001,672.99	2.60
5	071548001	15国开证券CP001	500,000	50,000,286.37	2.60
6	071511008	15国信证券CP008	500,000	49,991,238.41	2.60
7	071502007	15国泰君安CP007	500,000	49,989,371.57	2.60
8	140230	14国开30	400,000	39,998,140.53	2.08
9	150403	15农发03	300,000	30,120,013.22	1.56
10	011570004	15赣高速SCP004	300,000	30,008,669.72	1.56

17. “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	1
报告期内偏离度的最高值	0.2685%
报告期内偏离度的最低值	0.0327%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0869%

18. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。
19. 投资组合报告附注
19.1
本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定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，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值为1.0000 元。
19.2
本报告期内，本基金未持有剩余期限小于397 天但剩余存续期超过397 天的浮动利率债券，也不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过基金资产净值20%的情况。
19.3
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。
19.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	9,858,684.22
4	应收申购款	4,318,937.76
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	14,177,621.98

动力平衡基金投资组合报告
20. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	840,543,175.43	58.27
	其中：股票	840,543,175.43	58.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	351,398,000.00	24.36
	其中：债券	351,398,000.00	24.36
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	100,000,350.00	6.93
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	130,702,291.85	9.06
8	其他资产	19,838,177.04	1.38
9	合计	1,442,481,994.32	100.00

21. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	418,192,825.13	29.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	69,041,650.00	4.89
F	批发和零售业	42,916,121.87	3.04
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	259,057,842.39	18.37
J	金融业	-	-
K	房地产业	51,334,736.04	3.64
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	840,543,175.43	59.59

22. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300020	银江股份	5,263,976	86,118,647.36	6.11
2	002616	长青集团	2,811,224	64,011,570.48	4.54
3	300145	南方泵业	1,775,000	59,373,750.00	4.21
4	002572	索菲亚	1,527,202	58,522,380.64	4.15
5	600804	鹏博士	2,577,149	55,486,017.97	3.93
6	300273	和佳股份	2,819,081	54,380,072.49	3.86
7	600077	宋都股份	10,105,263	51,334,736.04	3.64
8	300115	长盈精密	1,855,832	50,905,471.76	3.61
9	002251	步步高	3,125,719	42,916,121.87	3.04
10	002238	天威视讯	2,673,699	38,902,320.45	2.76

23. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	351,398,000.00	24.91
	其中：政策性金融债	351,398,000.00	24.91
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	351,398,000.00	24.91

24. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	150202	15国开02	1,400,000	140,532,000.00	9.96
2	150215	15国开15	800,000	79,984,000.00	5.67
3	150403	15农发03	400,000	40,168,000.00	2.85
4	150211	15国开11	400,000	40,124,000.00	2.84
5	110417	11农发17	300,000	30,456,000.00	2.16

25. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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