景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第三季度报告

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
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

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本基金合同规定,于2015年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城中证500ETF
场内简称	景顺500
基金主代码	159935
交易代码	159935
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年12月26日
报告期末基金份额总额	58,572,956.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以中证500指数为标的指数,采用完全复制法,即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况(包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以根据市场情况,结合经验判断,综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中证500 指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金,被动跟踪标的指数的表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,196,084.03
2.本期利润	-35,608,379.30
3.加权平均基金份额本期利润	-0.7605
4.期末基金资产净值	92,987,820.63
5.期末基金份额净值	1.5876

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。

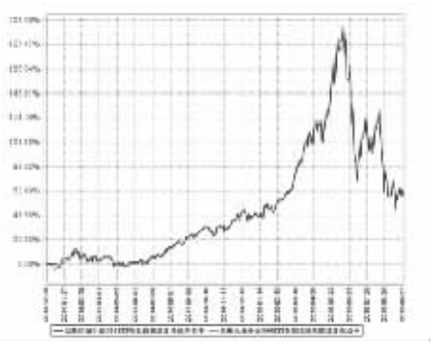
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	-30.84%	4.05%	-31.24%	4.03%	0.40%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金的投资组合比例为:本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股,投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%。本基金的建仓期为自2013年12月26日基金合同生效日起6个月。建仓期结束时,本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐喻军	上证180等权重交易型开放式指数基金、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数基金联接基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数基金、景顺长城中证500交易型开放式指数基金、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基金经理	2014年12月27日	-	5	理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012年3月加入本公司,担任量化及ETF投资部ETF专员职务;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、《景顺长城中证500交易型开放式指数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 公平交易专项说明

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

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度宏观经济未见起色,制造业和房地产投资持续低迷,消费和进出口数据依旧乏善可陈。PMI指数再次低于荣枯平衡线,显示生产动能很弱;PPI指数加速下滑,工业品通缩持续;CPI受季节性影响小幅回升,但上行空间有限。货币政策维持宽松,尽管股票市场波动以及汇率变化引起了阶段性的资金预期紧张,但央行通过公开市场操作,将资金利率维持在较低水平。

展望第4季度,需求疲软、价格走弱的局面未得到改善,传统行业去库存压力大,股灾对经济的负面作用也会逐步明显,4季度经济继续下滑的可能性较大。

本基金采用完全复制中证500指数的方法进行组合管理,通过控制跟踪误差和跟踪偏离度,力争基金收益和指数收益基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年3季度,本基金份额净值增长率为-30.84%,业绩比较基准收益率为-31.24%。报告期内,本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内,跟踪误差(年化)控制在2%以内。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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	84,274,452.44	90.22
	其中:股票	84,274,452.44	90.22
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,125,013.20	9.77
7	其他资产	8,487.04	0.01
8	合计	93,407,952.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	1,257,025.61	1.35
B	采矿业	2,017,500.37	2.17
C	制造业	49,500,243.06	53.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,065,376.64	3.30
E	建筑业	1,919,257.29	2.06
F	批发和零售业	6,157,971.67	6.62
G	交通运输、仓储和邮政业	3,016,917.12	3.24
H	住宿和餐饮业	56,848.41	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,404,637.61	4.74
J	金融业	610,345.14	0.66
K	房地产业	6,235,068.05	6.71
L	租赁和商务服务业	1,982,216.35	2.13
M	科学研究和技术服务业	389,870.20	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	625,759.00	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	311,805.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	1,625,864.34	1.75
S	综合	1,097,746.58	1.18
	合计	84,274,452.44	90.63

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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	601718	际华集团	42,947	517,511.35	0.56
2	600058	五矿发展	12,000	447,720.00	0.48
3	600655	豫园商城	28,100	435,269.00	0.47
4	600026	中海发展	38,070	421,815.60	0.45
5	600895	张江高科	21,700	412,734.00	0.44
6	600635	大众公用	55,200	407,376.00	0.44
7	600201	金宇集团	8,121	394,030.92	0.42
8	600737	中粮屯河	28,912	392,624.96	0.42
9	002405	四维图新	15,519	390,302.85	0.42
10	600079	人福医药	24,800	374,232.00	0.40

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,848.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,638.76
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,487.04

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资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	600058	五矿发展	447,720.00	0.48	筹划非公开发行股票
2	600026	中海发展	421,815.60	0.45	筹划重大事项

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	24,572,956.00
报告期期间基金总申购份额	52,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	18,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	58,572,956.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件;

2、《景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

3、《景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;

4、《景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司
2015年10月27日

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

【2015】第三季度报告

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
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

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本基金合同规定,于2015年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	景顺长城中证500ETF联接
场内简称	-
基金主代码	001455
交易代码	001455
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月29日
报告期末基金份额总额	131,259,140.43份
投资目标	本基金主要通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金,主要通过投资于目标ETF以达到投资目标。当本基金申购、赎回和买卖目标ETF,或基金日身的申购、赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,基金管理人会在10个交易日内对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。 在正常情况下,本基金力争相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	95%×中证500指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为ETF联接基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为股票型指数基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。
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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159935
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年12月26日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014年1月21日
基金管理人名称	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

基金名称	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以中证500指数为标的指数,采用完全复制法,即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况(包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以根据市场情况,结合经验判断,综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中证500 指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金,被动跟踪标的指数的表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-5,612,094.06
2.本期利润	-31,813,636.47
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1821
4.期末基金资产净值	104,562,842.57
5.期末基金份额净值	0.797

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。

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	-20.30%	2.62%	-29.76%	3.82%	9.46%	-1.20%

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

注:本基金的投资组合比例为:本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,同时不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或剔除日在一年以内的政府债券。本基金的建仓期为自2015年6月29日基金合同生效日起6个月。截至本报告期末,本基金仍处于建仓期。基金合同生效日(2015年6月29日)起至本报告期末不满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐喻军	上证180等权重交易型开放式指数基金、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数基金联接基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数基金、景顺长城中证500交易型开放式指数基金、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基金经理	2015年6月29日	-	5	理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012年3月加入本公司,担任量化及ETF投资部ETF专员职务;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、《景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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 公平交易专项说明

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

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度宏观经济未见起色,制造业和房地产投资持续低迷,消费和进出口数据依旧乏善可陈。PMI指数再次低于荣枯平衡线,显示生产动能很弱;PPI指数加速下滑,工业品通缩持续;CPI受季节性影响小幅回升,但上行空间有限。货币政策维持宽松,尽管股票市场波动以及汇率变化引起了阶段性的资金预期紧张,但央行通过公开市场操作,将资金利率维持在较低水平。

展望第4季度,需求疲软、价格走弱的局面未得到改善,传统行业去库存压力大,股灾对经济的负面作用也会逐步明显,4季度经济继续下滑的可能性较大。

本基金总景顺长城中证500ETF的联接基金,主要投资于景顺长城中证500ETF。目前目标ETF的成分股中仍然有20%左右的股票因停牌而不能投资,导致本基金持有目标ETF的比例低于基金资产净值的90%,随着停牌股票的逐渐复牌,本基金会力争在建仓期内使该比例符合基金合同规定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年3季度,本基金份额净值增长率为-20.30%,业绩比较基准收益率为-29.76%。报告期内,由于本基金处于建仓期间给逢市场下跌较多,本基金长期处于空仓或低仓位,因此导致本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值超过0.35%,跟踪误差(年化)超过4%。本基金管理人将根据本基金合同约定,采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大,并力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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	31,130,825.90	29.70
	其中:股票	31,130,825.90	29.70
2	基金投资	57,153,600.00	54.53
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	16,434,657.22	15.68
8	其他资产	85,807.82	0.08
9	合计	104,804,890.94	100.00

5.2 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	510,573.00	0.49
B	采矿业	686,944.10	0.66
C	制造业	18,062,902.70	17.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,235,784.00	1.18
E	建筑业	774,013.00	0.74
F	批发和零售业	2,383,418.00	2.28
G	交通运输、仓储和邮政业	1,127,051.00	1.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,674,351.10	1.60
J	金融业	203,860.00	0.19
K	房地产业	2,460,295.00	2.35
L	租赁和商务服务业	478,381.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	65,674.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	258,688.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	69,290.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	739,398.00	0.71
S	综合	400,203.00	0.38
	合计	31,130,825.90	29.77

5.3 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	601718	际华集团	18,500	222,925.00	0.21
2	600655	豫园商城	12,600	195,174.00	0.19
3	600201	金宇集团	3,900	189,228.00	0.18
4	600635	大众公用	22,800	168,264.00	0.16
5	000998	隆平高科	9,100	166,530.00	0.16
6	002701	奥瑞金	7,700	163,625.00	0.16
7	600737	中粮屯河	12,000	162,960.00	0.16
8	600895	张江高科	8,400	159,768.00	0.15
9	300144	宋城演艺	7,000	158,060.00	0.15
10	300072	三聚环保	5,000	157,550.00	0.15

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	31,566.93
2	应收证券清算款	86.81
3	应收股利	-
4	应收利息	204.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,124.16
8	其他	-
9	合计	46,982.22

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资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	000858	五粮液	8,364,823.00	8.68	筹划重大事项
2	000876	新希望	3,351,735.00	3.48	筹划重大事项

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	213,867,925.87
报告期期间基金总申购份额	5,702,534.84
减:报告期期间基金总赎回份额	88,311,320.28
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	131,259,140.43

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集注册的文件;

2、《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基金合同》;

3、《景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;

4、《景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司
2015年10月27日

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

【2015】第三季度报告

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
报告送出日期:2015年10月27日

§1 重要提示

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本基金合同规定,于2015年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城中证800食品饮料ETF
场内简称	景顺食品
基金主代码	512210
交易代码	512210
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014年7月18日
报告期末基金份额总额	83,809,435.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。
投资策略	本基金以中证800 食品饮料指数为标的指数,采用完全复制法,即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况(包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以根据市场情况,结合经验判断,综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。 本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。
业绩比较基准	中证800 食品饮料指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均预期风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金,被动跟踪标的指数的表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	5,383,616.29
2.本期利润	-37,561,049.75
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4334
4.期末基金资产净值	96,322,233.53
5.期末基金份额净值	1.1493

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)