景顺长城研究精选股票型证券投资基金

【2015】第三季度报告

2015年第3季度报告
2015年9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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	景顺长城研究精选股票
场内简称	-
基金主代码	000688
交易代码	000688
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月12日
报告期末基金份额总额	37,868,702.41份
投资目标	本基金依托基金管理人研究团队的研究成果,持续深度挖掘具有长期发展潜力的行业和上市公司,分享其在中国经济增长的大背景下的可持续性增长,以实现基金资产的长期资本增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,充分依据公司股票研究部行业研究员模拟组合和公司行业研究成果,采用"自下而上"精选个股策略,同时辅以"自上而下"资产配置和行业配置策略,在有效控制风险的前提下,实现基金资产的长期稳定增值。 1、资产配置:本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析,运用宏观经济模型(MEM)做出对于宏观经济的评价,结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议,经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。 2、股票投资策略:本基金采用"自下而上"精选个股策略,充分发挥基金管理人的研究优势,充分依据公司股票研究部行业研究员模拟组合,利用基金管理人股票研究数据库(SRD)对企业内在价值进行深入细致的分析,并进一步挖掘出具有竞争优势的上市公司股票进行投资。 3、债券投资策略 ;债券投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。 4、中小企业私募债投资策略:对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面,本基金会加强自下而上的分析,将机构评级与内部评级相结合,着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力,尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。
业绩比较基准	沪深300指数×90%+中证全债指数×10%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中风险程度较高的投资品种,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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	-3,717,985.88
2.本期利润	-17,316,961.71
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4432
4.期末基金资产净值	44,099,341.06
5.期末基金份额净值	1.165

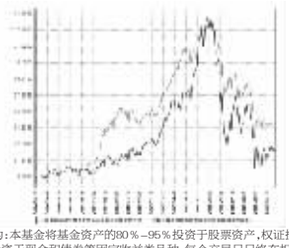
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-24.40%	4.33%	-25.52%	3.01%	1.12%	1.32%

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:本基金将基金资产的80%-95%投资于股票资产,权证投资比例不超过基金资产净值的3%,将基金资产的5%-20%投资于现金和债券等固定收益类品种,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,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自2014年8月12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		
江科宏	景顺长城中证医药卫生ETF、景顺长城中证800食品饮料ETF、景顺长城中证TMT150ETF、景顺长城研究精选股票型基金、景顺长城公司治理混合型基金、景顺长城优势企业混合型基金基金经理	2014年8月12日	-	8	经济学硕士,CFA。2007年至2010年担任本公司风险管理经理职务。2011年2月重新加入本公司,担任研究员等职务;自2012年6月起担任基金经理。
曹殿村	景顺长城支柱产业混合型证券投资基金基金经理、景顺长城稳健证券投资基金(LOF)基金经理、景顺长城研究精选股票型证券投资基金基金经理、研究部副总监	2014年12月27日	-	13	管理学博士。曾先后担任上海石油交易所交易员、北海国投深圳证券营业部分析师、北亚证券研发部分析师、第一创业证券研究所副所长、大成基金研究部高级研究员等职务。2010年3月加入本公司,担任研究副总监职务;自2012年11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、《景顺长城研究精选股票型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

2015年前三季度实体经济方面,实体经济下滑严重。1-8月份,全国规模以上工业企业实现利润同比下降1.9%,降幅比1-7月份扩大0.9个百分点,降幅继续扩大。8月单月,规模以上工业企业实现利润同比下降8.8%,降幅比7月份扩大5.9个百分点。分行业来看,1-8月份,采矿业同比下降57.3%,制造业增长4.5%,电力、热力、燃气及水生产和供应业增长13.1%。世界范围内的通缩和内需不足导致原材料和工业品出厂价格持续下滑,8月PPI下滑5.9%。固定资产投资维持平稳,进出口同比降幅双双扩大,名义消费增速保持稳定。

本基金依托本公司研究团队的研究成果,持续深度挖掘具有长期发展潜力的行业和上市公司,坚持自上而下的组合构建思路,重点把握行业的配置和行业龙头个股的投资策略。行业配置方面,重点配置受益于国家产业政策发展的行业,重点配置在成长类股票及转型发展企业方面:传媒、电子、计算机、通信、轻工、医药、医疗服务等行业。

展望4季度,当前经济下行压力依然较大,政策宽松的力度有望加码,流动性充裕的局面仍将持续。对于A股市场而言,宽松的政策环境有利于股市行情逐步走出底部。本轮市场调整以来,泡沫逐步得到挤压,未来中国经济的增长动力依然来自于改革创新,金融互联网、消费类股票(医药、家电、旅游等)、传统制造业向高端装备制造业及新兴产业转型的公司,以及国企改革、信息安全等符合国家战略发展方向的主题投资机会都有表现机会。

本基金操作思路上,仓位上处于可操作股票仓位中偏高的水平(80-95%);在行业配置与选股上主要以产业增长确定性高,公司相对经营稳定的公司为主。

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-24.40%,业绩比较基准收益率为-25.52%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从2015年8月24日至2015年9月30日,本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	39,866,681.15	89.46
	其中:股票	39,866,681.15	89.46
2	基金投资	-	-
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	4,633,057.31	10.40
8	其他资产	64,705.51	0.15
9	合计	44,564,443.97	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	19,559,118.55	44.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,218,248.00	7.30
E	建筑业	2,095,052.40	4.75
F	批发和零售业	805,275.00	1.83
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	5,910,073.22	13.40
J	金融业	2,313,215.00	5.25
K	房地产业	3,606,822.80	8.18
L	租赁和商务服务业	553,278.00	1.25
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	1,805,598.18	4.09
S	综合	-	-
	合计	39,866,681.15	90.40

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	300207	欣旺达	113,757	2,841,649.86	6.44
2	000958	东方能源	99,500	2,626,800.00	5.96
3	300009	安科生物	120,289	2,623,503.09	5.95
4	000024	招商地产	82,120	2,339,598.80	5.31
5	601515	东风股份	166,600	2,072,504.00	4.70
6	300020	银江股份	122,717	2,007,650.12	4.55
7	002174	游族网络	29,042	1,912,996.54	4.34
8	600804	鹏博士	86,972	1,872,507.16	4.25
9	300251	光线传媒	65,682	1,805,598.18	4.09
10	000090	天健集团	111,069	1,593,840.15	3.61

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

本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。

时点选择:基金管理人在交易股指期货时,重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向和技术指标等因素。

套保比例:基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值,具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

合约选择:基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

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	39,696.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	961.70
5	应收申购款	24,047.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,705.51

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

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	300020	银江股份	2,007,650.12	4.55	重大事项停牌
2	002174	游族网络	1,912,996.54	4.34	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	44,938,165.77
报告期期间基金总申购份额	10,448,873.88
减:报告期期间基金总赎回份额	17,518,337.24
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	37,868,702.41

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研究精选股票型证券投资基金募集注册的文件;
2、《景顺长城研究精选股票型证券投资基金基金合同》;
3、《景顺长城研究精选股票型证券投资基金招募说明书》;
4、《景顺长城研究精选股票型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

景顺长城优势企业混合型证券投资基金

【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	景顺长城优势企业混合
场内简称	-
基金主代码	000532
交易代码	000532
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月19日
报告期末基金份额总额	482,438,341.11份
投资目标	在中国经济转型的大背景下,深度挖掘具备竞争优势的优质企业进行投资,在有效控制风险的基础上实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置:本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析,运用宏观经济模型(MEM)做出对于宏观经济的评价,结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议,经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。 2、股票投资策略:本基金股票投资主要遵循"自下而上"的个股投资策略,利用基金管理人股票研究数据库(SRD)对企业内在价值进行深入细致的分析,并进一步挖掘出具有竞争优势的上市公司股票进行投资。 3、债券投资策略:债券投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+中证全债指数×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中风险程度较高的投资品种,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金和债券型基金,低于股票型基金。
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	-148,102,036.47
2.本期利润	-367,489,609.33
3.加权平均基金份额本期利润	-0.7353
4.期末基金资产净值	602,309,785.97
5.期末基金份额净值	1.248

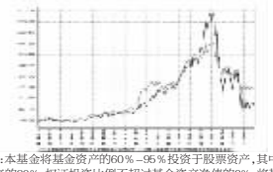
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-35.03%	4.34%	-22.60%	2.67%	-12.43%	1.67%

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:本基金将基金资产的60%-95%投资于股票资产,其中,投资于具备竞争优势的公司股票的资产不低于非现金基金资产的80%,权证投资比例不超过基金资产净值的3%,将基金资产的5%-40%投资于债券等固定收益类品种,其中,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,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自2014年3月19日基金合同生效日起6个月。建仓期结束时,本基金投资组合均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		
余广	景顺长城核心竞争力混合型基金、景顺长城品质投资混合型基金、景顺长城优势企业混合型基金、景顺长城精选蓝筹混合型基金基金经理,股票投资部投资总监	2014年3月19日	-	11	银行和金融工商管理硕士,中国注册会计师。曾先后担任蛇口中华会计师事务所审计项目经理、杭州中融投资管理有限公司财务顾问项目经理、世纪证券综合研究所研究员、中银国际(中国)证券风险管理部高级经理等职务。2005年1月加入本公司,担任研究员等职务;自2010年5月起担任基金经理。
江科宏	景顺长城中证医药卫生ETF、景顺长城中证800食品饮料ETF、景顺长城中证TMT150ETF、景顺长城研究精选股票型基金、景顺长城公司治理混合型基金、景顺长城优势企业混合型基金基金经理	2015年5月28日	-	8	经济学硕士,CFA。2007年至2010年担任本公司风险管理经理职务。2011年2月重新加入本公司,担任研究员等职务;自2012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。

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、《景顺长城优势企业混合型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

2015年3季度国内经济增长依然乏力,为了应对国内经济的压力,国家出台了购车税收优惠和住房按揭便利等政策。8月中旬人民币汇率意外贬值,在全球市场引起了震动,在央行的介入下,近期恐慌情绪逐渐平息。货币政策仍然宽松,3季度央行进一步降准降息,并进行公开市场操作,无风险利率一直保持在较低水平。由于人民币意外贬值等原因,市场在3季度大幅度下跌,沪深300指数下跌28.39%,创业板指数下跌27.14%。

3季度,本基金在操作上维持之前的较高仓位,在组合结构上保持较为均衡的配置,基金净值也随市场有部分回撤。

展望4季度,宏观经济还将保持在低位,转型过程是漫长的,短期经济亮点难寻。为了防止短期经济下行的幅度过大,货币政策仍将维持宽松。人民币汇率值得我们重点关注,若国内形成人民币贬值预期,将对国内的各类资产价格产生影响。

我们对A股市场仍然较为谨慎,均衡配置的风格将在下一个阶段延续,选股一直是我们投资流程的关键,本基金将坚持自下而上选股,买入持有具有竞争优势、管理优秀以及估值相对便宜或者合理的个股,力争获取长期投资回报。

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-35.03%,业绩比较基准收益率为-22.60%。

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	546,436,043.67	90.39
	其中:股票	546,436,043.67	90.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,121,500.00	6.64
	其中:债券	40,121,500.00	6.64
	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	10,880,725.50	1.80
8	其他资产	7,065,591.06	1.17
9	合计	604,503,860.23	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	205,061,326.32	34.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,374,630.50	2.22
F	批发和零售业	-	-
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	187,725,532.16	31.17
J	金融业	-	-
K	房地产业	42,855,261.47	7.12
L	租赁和商务服务业	41,617,380.04	6.91
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	23,812,841.00	3.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,049,392.42	2.00
R	文化、体育和娱乐业	19,939,679.76	3.31
S	综合	-	-
	合计	546,436,043.67	90.72

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	002303	美盈森	4,000,000	39,120,000.00	6.49
2	000917	电广传媒	2,000,000	38,600,000.00	6.41
3	300017	网宿科技	712,544	37,558,194.24	6.24
4	002572	索菲亚	908,800	34,825,216.00	5.78
5	000024	招商地产	1,085,019	30,912,191.31	5.13
6	300166	东方国信	880,900	25,942,505.00	4.31
7	600804	鹏博士	1,156,324	24,895,655.72	4.13
8	002400	省广股份	1,328,234	24,253,552.84	4.03
9	002508	老板电器	672,738	24,252,204.90	4.03
10	002573	清新环境	1,350,700	23,812,841.00	3.95

5.4 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	40,121,500.00	6.66
	其中:政策性金融债	40,121,500.00	6.66
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	40,121,500.00	6.66

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

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	200,000	20,062,000.00	3.33
2	150419	15农发19	100,000	9,994,000.00	1.66
3	140305	14进出05	50,000	5,049,500.00	0.84
4	150411	15农发11	50,000	5,016,000.00	0.83

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

本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。

时点选择:基金管理人在交易股指期货时,重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

套保比例:基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值,具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

合约选择:基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

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	338,663.28
2	应收证券清算款	6,008,633.22
3	应收股利	-
4	应收利息	515,893.76
5	应收申购款	202,400.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,065,591.06

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

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	002303	美盈森	39,120,000.00	6.50	发行股份购买资产
2	000917	电广传媒	38,600,000.00	6.41	发行股份购买资产

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	571,009,763.66
报告期期间基金总申购份额	56,201,896.03
减:报告期期间基金总赎回份额	144,773,318.58
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	482,438,341.11

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

根据2014年8月8日施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》(证监会令第104号)第三十条第一项的规定,股票基金的股票资产投资比例下限由60%上调至80%。景顺长城基金管理有限公司经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,自2015年8月7日起将"景顺长城优势企业股票型证券投资基金"更名为"景顺长城优势企业混合型证券投资基金",基金合同中的相关条款亦做相应修订。有关详细信息参见本公司于2015年8月7日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城优势企业股票型证券投资基金变更基金类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。

§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优势企业股票型证券投资基金募集注册的文件;
2、《景顺长城优势企业混合型证券投资基金基金合同》;
3、《景顺长城优势企业混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《景顺长城优势企业混合型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

景顺长城优信增利债券型证券投资基金

【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	景顺长城优信增利债券
场内简称	-
基金主代码	261002
交易代码	261002
基金运作方式