景顺长城景颐双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:北京银行股份有限公司
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。

基金托管人北京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	景顺长城景颐双利债券
场内简称	-
基金主代码	000385
交易代码	000385
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月13日
报告期末基金份额总额	2,093,411,397.63份
投资目标	本基金主要通过投资于固定收益品种,在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益,为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	1、资产配置策略:本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置,根据不同的经济发展阶段各类资产的投资机会,根据宏观经济、基准利率水平等因素,预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平,结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析,进行大类资产配置。 2、固定收益类资产投资策略: 债券类属资产配置:基金管理人根据国债、金融债、企业(公司)债、分离交易可转债债券部分等品种与同期限国债或央票之间收益率利差的扩大和收窄的分析,主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例,降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。 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。 资产支持证券投资策略:本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,并通过研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时,管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响,综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略。在严格控制风险的情况下,结合信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+1.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	北京银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	景顺长城景颐双利债券A类	景顺长城景颐双利债券C类
下属分级基金的交易代码	000385	000386
报告期末下属分级基金的份额总额	2,035,675,048.05份	57,736,349.58份

§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)	
	景顺长城景颐双利债券A类	景顺长城景颐双利债券C类
1. 本期已实现收益	-4,586,359.77	-156,617.56
2. 本期利润	9,536,680.98	68,628.27
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0047	0.0010
4. 期末基金资产净值	2,743,693,272.56	77,274,604.44
5. 期末基金份额净值	1.348	1.338

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

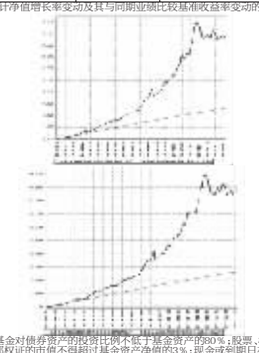
景顺长城景颐双利债券A类

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	0.45%	0.33%	1.17%	0.00%	-0.72%	0.33%

景顺长城景颐双利债券C类

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	0.30%	0.33%	1.17%	0.00%	-0.87%	0.33%

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:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%;股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%,其中,本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自2013年11月13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		
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、泰和回报灵活配置混合型基金、景颐双利债券型基金、景瑞增利债券型基金、景丰投币市场基金、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1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2006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,《景顺长城景颐双利债券型证券投资基金合同》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

宏观经济方面,3季度经济未见起色。其中消费乏善可陈,进出口数据负增长,制造业和房地产投资仍低迷;PMI指数再次落入衰退区间,新订单减存货的动能指标显示生产动能很弱。PPI指数下滑,工业品通缩压力持续;而CPI受季节性影响小幅回升,但继续大幅上行的空间有限。

货币政策维持宽松,6月底降准后流动性整体较为充裕,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逆回购、国库定存招标等方式及时对冲,平抑资金波动,将资金利率维持在较低的水平。当前在经济下行压力大、外部环境尚不稳定的情况下,央行仍可能适时加大基础货币投放,将利率维持在较低水平以支持实体经济。未来一段时间,随着资本市场压力逐渐释放,波动率会逐步下行,风险偏好进一步企稳。本基金以持有中盘流动较好的股票为主,虽然基准中停牌股比重较大,一度给选股带来挑战,但市场恢复正常后已逐渐缓解。

我们坚持在风险可控的前提下以量化基本面选股为主来产生超额收益,并在各类因子之间,尤其是在成长和价值之间进行了平衡的配置。

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-33.16%,业绩比较基准收益率为-29.76%。

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	196,263,528.45	6.18
	其中:股票	196,263,528.45	6.18
2	固定收益投资	2,879,926,519.90	90.69
	其中:债券	2,879,926,519.90	90.69
	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	26,599,095.49	0.84
7	其他资产	72,714,129.16	2.29
8	合计	3,175,503,273.00	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	74,019,226.85	2.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,040,000.00	1.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	20,118,752.00	0.71
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	-	-
J	金融业	26,340,000.00	0.93
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	20,451,200.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	26,294,349.60	0.93
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	196,263,528.45	6.96

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	002236	大华股份	1,089,273	36,828,320.13	1.31
2	000958	东方能源	1,100,000	29,040,000.00	1.03
3	600643	爱建股份	2,000,000	26,340,000.00	0.93
4	600292	中电远达	1,603,314	26,294,349.60	0.93
5	002400	省广股份	1,120,000	20,451,200.00	0.72
6	600313	农发种业	1,686,400	20,118,752.00	0.71
7	002045	国光电器	2,500,000	19,025,000.00	0.67
8	600885	宏发股份	646,934	18,165,906.72	0.64

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	15,009,000.00	0.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	161,467,000.00	5.72
	其中:政策性金融债	161,467,000.00	5.72
4	企业债券	1,371,497,987.90	48.62
5	企业短期融资券	110,632,000.00	3.92
6	中期票据	1,214,327,000.00	43.05
7	可转债	1,993,532.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	5,000,000.00	0.18
10	合计	2,879,926,519.90	102.09

注:其他项中为本基金持有的私募债,明细如下:

代码	名称	数量	票面利率(%)	期限(年)
125169	13准软01	50,000	10	3年,附债券存续期内的第2年末发行人上调票面利率选择权和投资者回售选择权

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	124751	14徐高铁	1,300,000	140,010,000.00	4.96
2	124831	14崇建设	1,000,000	105,160,000.00	3.73
3	101558012	15华强MTN002	1,000,000	101,640,000.00	3.60
4	1180130	11通泰债	700,000	73,157,000.00	2.59
5	1382050	13辽成大MTN1	700,000	70,910,000.00	2.51

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,467,079.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	71,123,592.66
5	应收申购款	123,457.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	72,714,129.16

5.10.4 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。

5.10.5 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	600643	爱建股份	26,340,000.00	0.93	因重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	景顺长城景颐双利债券A类	景顺长城景颐双利债券C类
报告期期初基金份额总额	1,918,499,162.35	77,984,172.69
报告期期间基金总申购份额	298,893,415.96	14,260,032.20
减:报告期期间基金总赎回份额	181,717,530.26	34,507,855.31
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	2,035,675,048.05	57,736,349.58

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景颐双利债券型证券投资基金募集注册的文件;

2、《景顺长城景颐双利债券型证券投资基金基金合同》;

3、《景顺长城景颐双利债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《景顺长城景颐双利债券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

景顺长城景益货币市场基金

【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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	景顺长城景益货币
场内简称	-
基金主代码	000380
交易代码	000380
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月26日
报告期末基金份额总额	2,725,103,061.09份
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,力争获取高于业绩比较基准的投资收益,实现基金的安全稳定回报。
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。
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	景顺长城景益货币A	景顺长城景益货币B
下属分级基金的交易代码	000380	000381
报告期末下属分级基金的份额总额	202,486,460.86份	2,522,616,600.23份

§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)	
	景顺长城景益货币A	景顺长城景益货币B
1. 本期已实现收益	1,292,799.78	15,674,610.05
2. 本期利润	1,292,799.78	15,674,610.05
3. 期末基金资产净值	202,486,460.86	2,522,616,600.23

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

景顺长城景益货币A

阶段	净值收益率①	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	0.5523%	0.0032%	0.3403%	0.0000%	0.2120%	0.0032%

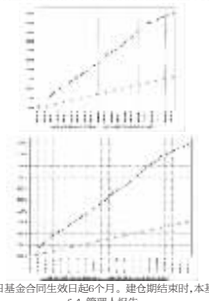
注:从2015年7月15日起,本基金的收益分配原则由"每日分配、按月支付"调整为"每日分配、按日支付"。

景顺长城景益货币B

阶段	净值收益率①	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	0.6132%	0.0032%	0.3403%	0.0000%	0.2729%	0.0032%

注:从2015年7月15日起,本基金的收益分配原则由"每日分配、按月支付"调整为"每日分配、按日支付"。

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:本基金的建仓期为自2013年11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		
袁媛	景顺长城四季金利债券型证券投资基金基金经理,景顺长城景益货币市场基金基金经理,景顺长城交易型货币市场基金基金经理,景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金经理,景顺长城交易型货币市场基金基金经理	2014年4月4日	-	8	经济学硕士。曾任职于齐鲁证券北四环营业部,也曾担任中航证券证券投资部投资经理、安信证券资产管理部投资主办等职务。2013年7月加入本公司,担任固定收益部资深研究员;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,《景顺长城景益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 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

宏观经济方面,3季度经济未见起色。其中消费乏善可陈,进出口数据负增长,制造业和房地产投资仍低迷;PMI指数再次落入衰退区间,新订单减存货的动能指标显示生产动能很弱。PPI指数下滑,工业品通缩压力持续;而CPI受季节性影响小幅回升,但继续大幅上行的空间有限。

货币政策维持宽松,6月底降准后流动性整体较为充裕,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逆回购、国库定存招标等方式及时对冲,平抑资金波动,将资金利率维持在较低的水平。当前在经济下行压力大、外部环境尚不稳定的情况下,央行仍可能适时加大基础货币投放,将利率维持在较低水平以支持实体经济。未来一段时间,随着资本市场压力逐渐释放,波动率会逐步下行,风险偏好进一步企稳。本基金以持有中盘流动较好的股票为主,虽然基准中停牌股比重较大,一度给选股带来挑战,但市场恢复正常后已逐渐缓解。

我们坚持在风险可控的前提下以量化基本面选股为主来产生超额收益,并在各类因子之间,尤其是在成长和价值之间进行了平衡的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年3季度,景顺货币A份额净值收益率为0.5523%,业绩比较基准收益率为0.3403%;景益货币B份额净值收益率为0.6132%,业绩比较基准收益率为0.3403%。

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	固定收益投资	1,581,930,882.72	57.51
	其中:债券	1,581,930,882.72	57.51
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	433,902,170.85	15.77
	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	718,182,328.69	26.11
4	其他资产	16,779,307.77	0.61
5	合计	2,750,794,690.03	100.00

注:银行存款和结算备付金其中包含定期存款713,000,000.00元。

5.2 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	1.25
	其中:买断式回购融资	0.00
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	22,999,845.50 / 0.84
	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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	63
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	63
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	22

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。

5.3.2 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	45.76	0.84
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	26.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	8.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	11.05	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	9.19	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		100.33	0.84

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	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	150,847,121.18	5.54
	其中:政策性金融债	150,847,121.18	5.54
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,431,083,761.54	52.51
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,581,930,882.72	58.05
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 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	071511008	15国信证券CP008	1,000,000	99,991,907.92	3.67
2	071502007	15国泰君安CP007	900,000	89,980,756.88	3.30
3	071503008	15中信CP008	800,000	80,018,354.47	2.94
4	071548001	15国开证券CP001	800,000	80,000,475.05	2.94
5	071501009	15招商CP009	800,000	79,991,696.10	2.94
6	011513002	15招商局SCP002	700,000	69,999,726.72	2.57
7	071507005	15中信建投CP005	700,000	69,991,484.26	2.57
8	011599725	15浙能源SCP002	600,000	59,977,458.61	2.20
9	140305	14进出05	500,000	50,495,081.04	1.85
10	041554026	15国电集CP002	500,000	50,336,012.69	1.85

5.6 "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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1212%
报告期内偏离度的最低值	0.0304%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0633%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

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。

5.8.2

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。

5.8.3 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。

5.8.4 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	应收股利	-
4	应收利息	14,604,568.78
5	应收申购款	2,174,738.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,779,307.77

§6 开放式基金份额变动

单位:份

序号	项目	景顺长城景益货币A	景顺长城景益货币B
	报告期期初基金份额总额	189,744,615.39	969,575,697.81
	报告期期间基金总申购份额	442,957,909.86	4,978,951,416.28
	减:报告期期间基金总赎回份额	430,216,064.39	3,425,910,513.86
	报告期期末基金份额总额	202,486,460.86	2,522,616,600.23

注:总申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额,总赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

§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《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》等相关法律法规、景顺长城景益货币市场基金基金合同的约定,经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致,本公司决定自2015年7月15日起,对本基金的收益分配原则、管理费率进行调整,上述修改为遵照法律法规和中国证监会的相关规定所作出的修改,对基金份额持有人利益无实质性不利影响,可不经基金份额持有人大会表决。有关详细信息参见本公司于2015年7月14日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于调整景顺长城景益货币市场基金收益分配原则、调低基金管理费率及相应修改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景益货币市场基金募集注册的文件;

2、《景顺长城景益货币市场基金基金合同》;

3、《景顺长城景益货币市场基金招募说明书》;

4、《景顺长城景益货币市场基金托管协议》;

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

景顺长城量化精选股票型证券投资基金

【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	景顺长城量化精选股票
场内简称	-
基金主代码	000978
交易代码	000