景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:景顺长城基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月24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2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城精选蓝筹混合
场内简称	无
基金主代码	260110
交易代码	260110
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年6月18日
报告期末基金份额总额	2,853,958,048.14份
投资目标	重点投资于具有较高内在投资价值的大型蓝筹上市公司,在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略,以市值规模和流动性为基础,重点投资于在行业内居于领导地位、具有较强的盈利能力和分红派现能力的稳健蓝筹公司以及在行业内具有较强竞争优势、成长性好的成长蓝筹公司。针对上述两类公司股票价格驱动因素的不同,本基金分别以价值和GARP(Growth at Reasonable Price)原则为基础,精选出具有投资价值的股票构建股票组合。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+中国债券总指数×20%。
风险收益特征	本基金是风险程度高的投资品种。
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	128,888,931.01
2.本期利润	76,663,990.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0266
4.期末基金资产净值	3,561,299,897.79
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	2.13%	0.71%	3.77%	0.47%	-1.64%	0.24%

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:本基金的资产配置比例为:股票投资70%-95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券投资5%-30%,权证投资0%-3%。本基金自2007年6月18日合同生效日起至2007年12月17日为建仓期。建仓期结束时,本基金投资组合比例均达到上述要求。

3.3 其他指标

无。

§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	本基金的基金经理、股票投资部投资总监	2014年10月28日	-	13年	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。

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、《景顺长城精选蓝筹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。

4.3.2.1 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。

4.3.2.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有24次,为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整,以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合银行间债券交易虽然存在临近交易日同向交易行为,但结合交易时机和交易价差分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。

本报告期内,未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度宏观经济基本面数据持续向好,体现出较强的经济韧性。3季度A股市场呈现逐级上涨并高位盘整态势,市场投资风格上半年是绩优蓝筹股、白马龙头股一枝独秀,到3季度创业板、中小板指数出现反弹,周期股、成长股表现较好。市场风格的变化使得绩优蓝筹出现了一定程度调整。3季度沪深300指数、中小板指和创业板指分别上涨4.6%、8.9%和2.7%。

下一阶段,新一轮财政整顿以及加强金融监管成为常态,预计经济可能面临回落压力,但韧性较强,下行幅度有限。A股上市公司整体业绩改善态势仍然较为明显,在基本面的支持下,相信A股的市场表现仍然较为稳健,预计绩优蓝筹股、优质成长股表现将相对更好。

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,买入持有质地优良、管理优秀以及估值合理的蓝筹股,以获取长期投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2017年3季度,本基金份额净值增长率为2.13%,业绩比较基准收益率为3.77%。

4.6 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	3,280,569,171.94	90.74
	其中:股票	3,280,569,171.94	90.74
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	76,938,435.41	2.13
	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	204,719,299.26	5.66
8	其他资产	53,043,350.16	1.47
9	合计	3,615,270,256.77	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	95,647,935.04	2.69
B	采矿业	39,793.60	0.00
C	制造业	1,973,192,833.89	55.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	285,561,083.60	8.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	100,127,666.73	2.81
G	交通运输、仓储和邮政业	44,019,463.61	1.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	99,067,468.03	2.78
J	金融业	415,234,624.45	11.66
K	房地产业	267,519,002.50	7.51
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	115,299.99	0.00
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	3,280,569,171.94	92.12

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	601318	中国平安	5,000,070	270,803,791.20	7.60
2	000651	格力电器	6,000,000	227,400,000.00	6.39
3	000333	美的集团	5,000,000	220,950,000.00	6.20
4	002035	华帝股份	8,000,029	215,600,781.55	6.05
5	600519	贵州茅台	400,000	207,056,000.00	5.81
6	000858	五粮液	3,000,090	171,845,155.20	4.83
7	002572	索菲亚	4,000,000	151,200,000.00	4.25
8	000001	平安银行	13,000,075	144,430,833.25	4.06
9	600674	川投能源	15,000,000	141,300,000.00	3.97
10	002303	美盈森	15,000,000	127,650,000.00	3.58

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本期末未持有债券。

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

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。

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	644,651.91
2	应收证券清算款	52,147,044.06
3	应收股利	-
4	应收利息	63,450.55
5	应收申购款	188,203.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,043,350.16

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,740,351,598.76
报告期期间基金总申购份额	438,605,061.91
减:报告期期间基金总赎回份额	324,998,612.53
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	2,853,958,048.14

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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 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精选蓝筹股票型证券投资基金募集注册的文件;

2、《景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金基金合同》;

3、《景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《景顺长城精选蓝筹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

2017年10月25日

景顺长城景丰货币市场基金

2017年第三季度报告

基金管理人:景顺长城基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月24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2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城景丰货币
场内简称	无
基金主代码	000701
交易代码	000701
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月16日
报告期末基金份额总额	17,101,931,493.14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,通过运用各种投资工具及投资策略,力争获取高于业绩比较基准的投资回报。
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	兴业银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	景顺长城景丰货币A / 景顺长城景丰货币B
下属分级基金的交易代码	000701 / 000707
报告期末下属分级基金的份额总额	210,004,316.35份 / 16,891,927,176.79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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)	
	景顺长城景丰货币A	景顺长城景丰货币B
1.本期已实现收益	2,406,373.38	175,422,195.53
2. 本期利润	2,406,373.38	175,422,195.53
3. 期末基金资产净值	210,004,316.35	16,891,927,176.79

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

景顺长城景丰货币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	0.9877%	0.0009%	0.3403%	0.0000%	0.6474%	0.0009%

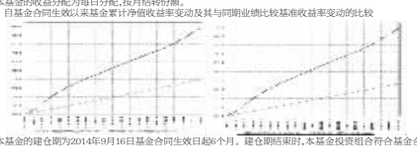
注:本基金的收益分配为每日分配,按月结转份额。

景顺长城景丰货币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	1.0501%	0.0009%	0.3403%	0.0000%	0.7098%	0.0009%

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2014年9月16日基金合同生效日起6个月。建仓期结束时,本基金投资组合符合基金合同的有关约定。

§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		
陈威霖	本基金的基金经理	2016年4月20日	-	6年	管理学硕士。曾担任平安利顺货币经纪公司债券市场部债券经纪人。2013年6月加入本公司,先后担任交易管理部交易员、固定收益部信用研究员;自2016年4月起担任基金经理。
成念良	本基金的基金经理	2015年12月11日	-	8年	管理学硕士。曾担任大公国际资信评级有限公司评级部高级信用分析师,平安大华基金投研部信用研究员、专户业务部投资经理。2015年9月加入本公司,自2015年12月起担任固定收益部基金经理。

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、《景顺长城景丰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

本报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有24次,为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整,以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合银行间债券交易虽然存在临近交易日同向交易行为,但结合交易时机和交易价差分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。

本报告期内,未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度经济数据基本延续2季度的走势,并未出现较明显的回落,工业品价格回升,推动PPI走高。货币政策仍维持中性,金融去杠杆仍在进行,非银体系资金面明显偏紧,资金利率较高。海外经济数据仍处于复苏态势,美联储12月加息预期回升。受大宗商品价格回升和资金面偏紧影响,债券收益率先下后上,3季度10年期国债、10年期国开债、5年期AAA中票、5年期AA中票、1年AAA短融分别上行4BP、下行1BP、上行13BP、下行13BP和上行12BP至3.61%、4.19%、4.72%、5.23%和4.53%。

组合在9月进入自由开放期,3季度组合不断减仓以应对赎回压力,持仓结构上,以中高等级信用债为主。

展望4季度基本面,经济增长动能仍在,但受资金约束、地产长效机制推动,经济数据未来仍面临一定幅度的回落压力。CPI数据近期略超预期,但由于基数原因预计年内通胀压力较小;PPI在需求走弱的背景下将呈现出回落的趋势,对工业企业利润的增长形成一定压制,考虑到冬季环保限产和供给侧改革因素,预计环比回落幅度不会太大。

海外方面,美联储暂表和加息临近,欧洲央行利率决议仍保持谨慎基调,计划在“必要时”维持QE计划至今年12月份以后,全球发达经济体的货币政策以收紧为主。

资金面上,超储率偏低的背景下,未来资金面走势很大程度上仍由央行公开市场操作决定。在稳健中性的货币政策态度下,央行预计将继续削峰填谷保持流动性的不松不紧,但非银体系的资金面仍可能阶段性偏紧。

政策面上,未来预计央行货币政策继续维持中性态度,若四季度经济数据出现持续下行,边际上可能会略有宽松,但趋势性宽松出现的可能性不大。监管方面,4季度出台去金融杠杆政策的可能性较大,重点可能在统一资产管理业务的标准规制,强化实质性和穿透式监管,不过在维护国家金融稳定的考虑下,未来监管政策的出台方式将更加温和,同时随着政策出台的速度减缓,监管对市场的冲击将更趋弱化。9月下旬的远期定向降准政策目的是支持实体经济,并不意味“全面宽松周期”开启,更多是结构性调整。但也意味着货币政策不再更加从紧。

利率债在当前位置具有配置价值,顶部相对明确,但经济韧性强、海外收紧背景下大幅宽松难现等因素使趋势性下行机会还需等待。先行数据显示基本面开始回落,叠加严格的金融监管政策,表外融资收缩将增加经济下行压力,未来基本面变化需要关注。信用债由于信用利差反应并不充分,低等级信用债仍面临信用利差走扩风险,维持择优选择中高等级配置的观点。

操作计划上,在控制杠杆比例和久期的前提下,组合以获取信用债的票息收入为主,并关注可转债的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2017年3季度,本基金份额净值增长率为1.07%,业绩比较基准收益率为0.63%。

4.6 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	271,678,853.54	95.77
	其中:债券	271,678,853.54	95.77
	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	5,718,763.57	2.02
8	其他资产	6,275,051.28	2.21
9	合计	283,672,668.39	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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	49,832,057.91	0.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,028,065,571.12	6.01
	其中:政策性金融债	1,028,065,571.12	6.01
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	679,962,266.96	3.98
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,935,863,378.21	23.01
8	其他	-	-
9	合计	5,693,723,274.20	33.29
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	1.58	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	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基金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

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的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	68
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	69
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	19

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内,本基金投资组合平均剩余期限未超过120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	41.48	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	15.83	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	24.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	4.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	14.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.88	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内,本基金投资组合平均剩余期限未超过240天。

5.5 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	49,832,057.91	0.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,028,065,571.12	6.01
	其中:政策性金融债	1,028,065,571.12	6.01
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	679,962,266.96	3.98
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,935,863,378.21	23.01
8	其他	-	-
9	合计	5,693,723,274.20	33.29
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 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	170410	17农发10	5,200,000	518,490,013.02	3.03
2	111705081	17建设银行CD081	3,500,000	346,969,809.10	2.03
3	111715342	17民生银行CD342	3,000,000	297,079,694.38	1.74
4	111708327	17中信银行CD327	3,000,000	297,078,332.89	1.74
5	111708330	17中信银行CD330	3,000,000	296,992,454.50	1.74
6	111709375	17浦发银行CD375	3,000,000	296,992,454.50	1.74
7	111717218	17光大银行CD218	2,500,000	247,825,640.34	1.45
8	011758088	17长电SCP003	2,100,000	210,004,917.37	1.23
9	111708324	17中信银行CD324	2,000,000	198,067,127.16	1.16
10	111709370	17浦发银行CD370	2,000,000	198,067,127.16	1.16
9	111720214	17广发银行CD214	2,000,000	198,012,434.05	1.16
10	111717223	17光大银行CD223	2,000,000	195,922,810.18	1.15

5.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0568%
报告期内偏离度的最低值	-0.0037%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0222%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内,本货币基金未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内,本货币基金未发生正偏离度的绝对值达到0.50%的情况。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金采用摊余成本法计价,因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。

5.9.2

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。

5.9.3 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	46,313,574.08
4	应收申购款	9,979,582.64
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	56,293,156.72

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,012,972,168.96
报告期期间基金总申购份额	136,578,522.15
报告期期间基金总赎回份额	939,546,374.75
报告期期末基金份额总额	210,004,316.35

报告期期初基金份额总额	18,320,369,839.84
报告期期间基金总申购份额	34,114,663,423.42
报告期期间基金总赎回份额	35,543,106,086.47
报告期期末基金份额总额	16,891,927,176.79

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交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2017年7月17日	292,111.56	292,111.56	0.00%
2	申赎	2017年8月4日	60,000,000.00	60,000,000.00	0.00%
3	红利再投	2017年8月15日	328,497.13	328,497.13	0.00%
4	申赎	2017年9月7日	55,000,000.00	55,000,000.00	0.00%
5	申赎	2017年9月7日	30,000,000.00	30,000,000.00	0.00%
6	红利再投	2017年9月15日	571,449.59	571,449.59	0.00%
7	申赎	2017年9月19日	8,000,000.00	-8,000,000.00	0.00%
合计			154,192,058.28	138,192,058.28	

注:基金管理人本期运用固有资金投资本基金均为本基金的B类基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
	1	20170920--20170930	1,000,000.00	4,007,723.73	1,000,000.00	4,007,